

Fecha de Publicación: 14 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 10 de Septiembre de 2010 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$871,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	114,4	114,7	50,0	46,0	34,7	38,4	30,0
15-35	190,7	305,6	129,5	94,0	121,1	41,7	55,0
36-60	4,3	16,8	0,0	0,0	16,8	4,3	0,0
61-90	37,5	18,9	5,0	35,0	13,9	2,5	0,0
91-180	40,9	19,5	0,0	40,0	19,5	0,9	0,0
>180	0,0	7,7	5,0	0,0	2,7	0,0	0,0
Total	387,8	483,1	189,5	215,0	208,6	87,8	85,0

* Cifras en millones de dólares

** Incluye operaciones interbancarias y operacines con los otros agentes

*** Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,6 %	0,9 %	0,8 %	0,8 %
15-35	2,1 %	1,3 %	0,5 %	1,2 %
36-60	-	1,0 %	0,7 %	0,9 %
61-90	-	1,1 %	1,1 %	1,1 %
91-180	-	1,5 %	1,2 %	1,3 %
>180	-	1,5 %	-	1,5 %
Total	1,6 %	1,2 %	0,8 %	1,1 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	6 al 10 de Septiembre				13 al 17 de Septiembre				20 al 24 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	488	1856	1738	43	207	1945	2032	8	144	1555	1421
Intragrupa y off-shore***	0	0	920	656	0	0	1124	778	0	0	948	648
Otros	488	10	420	802	207	43	544	804	144	8	289	725
Total	498	498	3196	3196	250	250	3613	3613	152	152	2793	2793

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

** Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

*** Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo