

Fecha de Publicación: 15 de Septiembre de 2010
 Fecha de Información: 13 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\$1324,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	251,8	118,3	15,0	147,0	63,3	64,8	40,0
15-35	298,2	391,7	219,0	144,5	97,7	78,7	75,0
36-60	115,9	42,7	20,0	80,0	12,7	25,9	10,0
61-90	0,2	3,4	0,0	0,0	3,4	0,2	0,0
91-180	21,4	76,7	0,0	0,0	76,7	21,4	0,0
>180	0,3	3,7	0,0	0,0	3,7	0,3	0,0
Total	687,7	636,5	254,0	371,5	257,5	191,2	125,0

* 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	0,2 %	0,7 %	1,6 %	1,2 %
15-35	2,6 %	1,7 %	0,4 %	1,4 %
36-60	0,7 %	1,0 %	0,6 %	0,8 %
61-90	-	1,5 %	0,3 %	1,5 %
91-180	-	1,2 %	0,8 %	1,1 %
>180	-	2,1 %	1,5 %	2,0 %
Total	1,7 %	1,4 %	1,0 %	1,3 %

*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

Sectores	13 al 17 de Septiembre				20 al 24 de Septiembre				27 de Sep. al 1 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	208	2125	2062	9	144	1611	1468	5	307	1765	1585
Intragrupo y off-shore***	0	0	1110	903	0	0	948	660	0	0	772	510
Otros	208	44	549	819	144	9	337	768	307	5	545	986
Total	252	252	3784	3784	153	153	2896	2896	313	313	3082	3082

* 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