

Fecha de Publicación: 16 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 14 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\$1294,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,5%.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	268,4	101,8	0,0	195,5	95,8	66,9	6,0
15-35	392,4	306,6	162,5	124,4	72,1	196,0	72,0
36-60	10,0	9,8	0,0	0,0	9,8	10,0	0,0
61-90	2,8	23,6	0,1	0,0	23,5	2,8	0,0
91-180	41,3	69,7	54,2	0,0	15,5	41,3	0,0
>180	2,7	65,5	14,0	0,0	51,5	2,7	0,0
Total	717,5	576,9	230,7	319,9	268,2	319,6	78,0

* 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	0,7 %	0,8 %	0,0 %	0,3 %
15-35	0,4 %	1,0 %	0,0 %	0,4 %
36-60	-	1,0 %	-0,3 %	0,3 %
61-90	-	1,0 %	-0,3 %	0,8 %
91-180	-	1,3 %	0,7 %	0,9 %
>180	-	2,5 %	1,0 %	2,4 %
Total	0,4 %	1,2 %	0,0 %	0,5 %

* 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	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	209	2264	2088	10	144	1724	1557	7	309	1796	1618
Intragrupa y off-shore***	6	0	1133	1038	0	0	948	735	0	0	777	525
Otros	203	44	552	822	144	10	425	804	309	7	567	997
Total	253	253	3949	3949	154	154	3097	3097	315	315	3140	3140

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo