

Fecha de Publicación: 17 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 15 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\$1121,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,2%.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	91,1	134,3	36,0	23,5	76,3	45,6	22,0
15-35	319,1	287,1	172,0	203,5	79,1	79,6	36,0
36-60	172,7	20,9	17,0	0,0	3,9	172,7	0,0
61-90	19,7	10,6	0,0	0,0	10,6	19,7	0,0
91-180	14,4	28,7	10,0	0,0	18,7	14,4	0,0
>180	6,3	16,9	5,0	0,0	5,9	0,3	6,0
Total	623,3	498,5	240,0	227,0	194,5	332,3	64,0

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

* 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**	43	208	2279	2110	11	146	1777	1632	8	309	1850	1665
Intragrupa y off-shore***	6	0	1155	1038	0	0	962	756	0	0	777	558
Otros	203	43	552	837	146	11	473	826	309	8	603	1007
Total	251	251	3986	3986	157	157	3213	3213	317	317	3230	3230

* 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