

Fecha de Publicación: 20 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 16 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\$682,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,4%.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	128,2	87,6	3,0	37,5	84,6	90,7	0,0
15-35	113,5	180,6	117,4	76,0	36,2	10,5	27,0
36-60	4,6	3,4	0,0	0,0	3,4	4,6	0,0
61-90	40,5	5,7	0,0	0,0	5,7	40,5	0,0
91-180	4,6	24,5	20,0	0,0	4,5	4,6	0,0
>180	37,2	52,2	15,0	10,0	37,2	27,2	0,0
Total	328,6	353,9	155,4	123,5	171,6	178,1	27,0

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

* 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	359	2279	1960	11	146	1894	1642	8	374	1862	1674
Intragrupa y off-shore***	6	0	1155	1038	0	0	962	793	0	0	780	558
Otros	353	43	401	837	146	11	484	905	374	8	610	1019
Total	401	401	3835	3835	157	157	3340	3340	382	382	3251	3251

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