

Fecha de Publicación: 21 de Septiembre de 2010
 Fecha de Información: 17 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\$791,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	154,1	151,5	20,0	48,0	66,5	41,1	65,0
15-35	108,0	233,9	157,8	28,0	36,1	40,0	40,0
36-60	0,1	22,4	0,0	0,0	22,4	0,1	0,0
61-90	55,9	17,1	0,0	20,0	17,1	35,9	0,0
91-180	18,1	24,9	0,0	0,0	24,9	18,1	0,0
>180	0,2	5,2	0,0	0,0	5,2	0,2	0,0
Total	336,4	455,0	177,8	96,0	172,2	135,4	105,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-0,3 %	0,2 %	-1,1 %	-0,3 %
15-35	0,0 %	0,2 %	-0,5 %	0,0 %
36-60	-	0,7 %	-0,6 %	0,7 %
61-90	-	0,7 %	-0,2 %	0,0 %
91-180	-	0,8 %	0,5 %	0,7 %
>180	-	2,1 %	2,6 %	2,1 %
Total	-0,2 %	0,3 %	-0,5 %	0,0 %

*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	12	154	2018	1732	8	374	1891	1729
Intragruppo y off-shore***	6	0	1212	1123	0	0	1077	914	0	0	928	573
Otros	353	43	345	752	154	12	403	853	374	8	506	1023
Total	401	401	3835	3835	165	165	3499	3499	383	383	3325	3325

* 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 intragruppo