

Fecha de Publicación: 22 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 20 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\$666,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,3%.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	88,4	87,1	44,0	45,0	23,1	23,4	20,0
15-35	137,6	147,2	92,0	102,7	25,0	4,6	30,2
36-60	31,8	47,7	20,0	0,0	5,0	9,1	22,7
61-90	38,3	23,8	14,0	0,0	9,8	38,3	0,0
91-180	29,5	10,7	0,0	5,0	10,7	24,5	0,0
>180	10,2	14,5	10,0	10,0	4,5	0,2	0,0
Total	335,7	331,0	180,0	162,7	78,1	100,1	72,9

* 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 %	1,2 %	-0,4 %	0,3 %
15-35	-0,5 %	0,1 %	0,0 %	0,0 %
36-60	0,0 %	0,4 %	-0,1 %	0,2 %
61-90	-	0,7 %	-0,3 %	0,1 %
91-180	-	0,9 %	2,9 %	2,4 %
>180	-	1,6 %	2,1 %	1,8 %
Total	-0,2 %	0,5 %	0,3 %	0,3 %

* 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

Sector	20 al 24 de Septiembre				27 de Sep. al 1 de Octubre				4 al 8 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	159	2063	1781	8	375	1935	1761	5	200	1660	1601
Intragrupa y off-shore***	0	0	1103	938	0	0	946	594	0	0	981	538
Otros	159	12	407	853	375	8	520	1046	200	5	275	777
Total	170	170	3573	3573	383	383	3400	3400	205	205	2916	2916

* 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