

Fecha de Publicación: 23 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 21 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\$654,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 00%.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	94,6	88,3	60,0	6,7	13,3	72,9	15,0
15-35	189,2	166,9	120,0	84,3	19,4	77,5	27,5
36-60	3,1	3,2	0,0	0,0	3,2	3,1	0,0
61-90	35,4	28,6	0,0	0,0	28,6	35,4	0,0
91-180	25,6	10,5	0,0	0,0	10,5	25,6	0,0
>180	0,3	8,7	0,0	0,0	8,7	0,3	0,0
Total	348,3	306,2	180,0	91,0	83,7	214,9	42,5

* 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 %	-1,2 %	-0,8 %
15-35	0,1 %	0,4 %	-0,1 %	0,1 %
36-60	-	0,7 %	0,0 %	0,3 %
61-90	-	0,2 %	0,2 %	0,2 %
91-180	-	1,1 %	0,8 %	0,9 %
>180	-	1,7 %	1,5 %	1,7 %
Total	0,0 %	0,4 %	-0,3 %	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	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	2118	1801	9	375	1962	1825	6	200	1710	1608
Intragrupa y off-shore***	0	0	1103	938	0	0	1001	596	0	0	986	573
Otros	159	12	411	893	375	9	529	1071	200	6	277	791
Total	171	171	3632	3632	383	383	3492	3492	206	206	2973	2973

* 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