

Fecha de Publicación: 24 de Septiembre de 2010
 Fecha de Información: 22 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\$937,7 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	115,0	127,2	95,2	64,7	17,0	35,3	15,0
15-35	231,3	294,3	248,0	107,0	5,3	83,3	41,0
36-60	3,1	2,5	0,0	0,0	2,5	3,1	0,0
61-90	71,3	15,5	0,0	13,0	15,5	58,3	0,0
91-180	20,9	34,5	0,0	0,0	34,5	20,9	0,0
>180	0,4	21,9	20,0	0,0	1,9	0,4	0,0
Total	441,9	495,8	363,2	184,7	76,6	201,2	56,0

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

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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	160	2171	1822	9	375	2022	1916	6	200	1714	1628
Intragrupa y off-shore***	0	0	1124	982	0	0	1075	632	0	0	991	558
Otros	160	12	411	903	375	9	545	1095	200	6	277	795
Total	171	171	3707	3707	384	384	3643	3643	206	206	2982	2982

* 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.