

Fecha de Publicación: 28 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 24 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\$812,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,6%.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	93,8	53,8	13,0	67,0	40,8	26,8	0,0
15-35	282,0	248,9	175,0	194,0	37,9	52,0	36,0
36-60	16,5	9,2	0,0	0,0	9,2	16,5	0,0
61-90	5,4	14,5	0,0	5,0	14,5	0,4	0,0
91-180	38,2	42,1	0,0	25,0	42,1	13,2	0,0
>180	3,4	4,4	0,0	3,0	4,4	0,4	0,0
Total	439,3	372,8	188,0	294,0	148,8	109,3	36,0

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

* 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	157	2171	1821	10	376	2192	1977	7	200	1740	1639
Intragrupa y off-shore***	0	0	1124	982	0	0	1086	695	0	0	1009	562
Otros	157	12	411	903	376	10	576	1182	200	7	269	818
Total	169	169	3706	3706	387	387	3854	3854	207	207	3019	3019

* 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