

Fecha de Publicación: 1 de Octubre de 2010
Fecha de Información: 29 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\$1065,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.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	130,3	31,0	14,5	83,2	16,5	47,1	0,0
15-35	289,4	421,4	201,1	158,7	129,3	39,7	91,0
36-60	45,3	3,6	0,0	0,0	3,6	45,3	0,0
61-90	82,0	16,6	0,0	0,0	16,6	82,0	0,0
91-180	10,8	6,7	0,0	0,0	6,7	10,8	0,0
>180	16,4	12,2	0,1	10,0	7,1	1,4	5,0
Total	574,2	491,6	215,7	251,9	179,9	226,3	96,0

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

* 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	27 de Sep. al 1 de Octubre				4 al 8 de Octubre				11 al 15 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	363	2378	2070	14	200	1973	1778	12	165	1730	1457
Intragrupa y off-shore***	0	0	1109	781	0	0	1044	645	0	0	969	761
Otros	363	10	586	1222	200	14	289	884	165	12	161	643
Total	373	373	4073	4073	214	214	3306	3306	177	177	2860	2860

* 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