

Fecha de Publicación: 5 de Octubre de 2010
Fecha de Información: 01 de Octubre de 2010¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$664,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 00%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	42,8	24,0	0,0	18,5	24,0	24,3	0,0
15-35	153,0	296,6	95,6	47,6	142,0	46,4	59,0
36-60	62,0	16,8	0,0	0,0	16,8	62,0	0,0
61-90	27,3	8,5	0,0	0,0	8,5	27,3	0,0
91-180	9,4	18,7	0,0	0,0	18,7	9,4	0,0
>180	0,5	5,2	0,0	0,0	5,2	0,5	0,0
Total	295,1	369,8	95,6	66,1	215,2	170,0	59,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	0,2 %	0,3 %	0,3 %
15-35	-0,1 %	0,1 %	-0,4 %	-0,1 %
36-60	-	0,7 %	-0,2 %	0,0 %
61-90	-	0,6 %	-0,1 %	0,1 %
91-180	-	1,1 %	0,1 %	0,8 %
>180	-	1,6 %	0,2 %	1,5 %
Total	-0,1 %	0,2 %	-0,2 %	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	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	2382	2081	15	200	2037	1792	13	170	1760	1512
Intragruppo y off-shore***	0	0	1134	785	0	0	1049	674	0	0	992	762
Otros	363	10	571	1222	200	15	298	918	170	13	193	672
Total	373	373	4088	4088	216	216	3383	3383	183	183	2945	2945

* 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 intragruppo