

Fecha de Publicación: 12 de Octubre de 2010
Fecha de Información: 08 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\$829,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,3%.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	76,0	109,1	48,0	30,0	26,1	11,0	35,0
15-35	242,8	189,6	102,2	132,0	52,4	75,8	35,0
36-60	65,8	35,1	0,4	0,0	14,7	45,8	20,0
61-90	42,8	5,5	0,0	0,0	5,5	42,8	0,0
91-180	28,4	28,2	0,0	0,0	28,2	28,4	0,0
>180	0,0	5,7	0,7	0,0	5,0	0,0	0,0
Total	455,9	373,2	151,3	162,0	131,9	203,9	90,0

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

* 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	4 al 8 de Octubre				11 al 15 de Octubre				18 al 22 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	188	2150	1896	21	165	2076	1648	12	235	1215	1352
Intragrupa y off-shore***	0	0	1138	762	0	1	1061	919	0	0	864	338
Otros	188	19	313	942	165	20	259	830	234	12	252	641
Total	207	207	3600	3600	186	186	3397	3397	247	247	2331	2331

* 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 intragrupo