

Fecha de Publicación: 15 de Octubre de 2010
Fecha de Información: 13 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\$905,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,2%.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	97,2	113,7	23,0	41,5	71,2	36,2	19,5
15-35	185,9	298,5	121,5	105,0	126,5	30,4	50,5
36-60	21,2	3,3	0,0	0,0	3,3	21,2	0,0
61-90	56,2	19,2	0,0	13,0	19,2	43,2	0,0
91-180	54,1	26,3	15,0	15,0	11,3	39,1	0,0
>180	15,9	13,5	0,0	15,0	13,5	0,9	0,0
Total	430,5	474,6	159,5	189,5	245,1	171,0	70,0

* 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	11,4 %	0,0 %	-0,3 %	1,2 %
15-35	-0,1 %	-0,1 %	-0,4 %	-0,2 %
36-60	-	0,8 %	-0,3 %	-0,1 %
61-90	-	0,6 %	-0,2 %	0,0 %
91-180	-	0,4 %	0,0 %	0,2 %
>180	-	1,5 %	1,3 %	1,4 %
Total	3,1 %	0,1 %	-0,2 %	0,2 %

* 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	11 al 15 de Octubre				18 al 22 de Octubre				25 al 29 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	168	2269	1756	17	234	1303	1418	16	369	2038	1525
Intragrupa y off-shore***	0	1	1095	1064	0	0	899	366	19	0	825	857
Otros	168	24	294	839	234	17	273	691	350	16	312	791
Total	193	193	3659	3659	251	251	2475	2475	385	385	3174	3174

* 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