

Fecha de Publicación: 22 de Octubre de 2010
Fecha de Información: 20 de Octubre 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\$968,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,1%.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	76,2	53,6	20,0	13,0	33,6	63,2	0,0
15-35	186,1	379,3	237,5	63,0	73,8	55,1	68,0
36-60	7,6	15,8	10,9	0,0	4,9	7,6	0,0
61-90	12,8	68,5	50,0	0,0	18,5	12,8	0,0
91-180	125,6	20,8	0,0	20,0	20,8	105,6	0,0
>180	17,4	4,3	0,0	16,0	4,3	1,4	0,0
Total	425,8	542,3	318,4	112,0	155,9	245,8	68,0

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

*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	18 al 22 de Octubre				25 al 29 de Octubre				1 al 5 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	220	1668	1569	24	354	2166	1678	4	175	1562	1548
Intragrupa y off-shore***	0	0	993	469	4	0	870	904	0	0	920	570
Otros	220	21	294	916	350	24	357	811	175	4	215	579
Total	241	241	2954	2954	378	378	3393	3393	179	179	2697	2697

* 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