

Fecha de Publicación: 28 de Octubre de 2010
Fecha de Información: 26 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\$1077,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.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	127,5	108,7	79,0	74,0	9,7	33,5	20,0
15-35	273,0	329,7	211,5	83,0	21,2	93,0	97,0
36-60	42,6	51,9	45,0	0,0	6,9	42,6	0,0
61-90	51,3	13,4	0,0	0,0	7,4	45,3	6,0
91-180	22,3	26,2	15,0	0,0	11,2	22,3	0,0
>180	27,4	3,2	0,0	10,0	2,9	17,0	0,4
Total	544,1	533,2	350,5	167,0	59,3	253,7	123,4

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

*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	25 al 29 de Octubre				1 al 5 de Noviembre				8 al 12 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	355	2436	1924	10	175	1737	1671	11	139	1269	1229
Intragrupa y off-shore***	4	0	1024	1083	0	0	967	630	0	0	753	373
Otros	352	31	428	881	175	10	236	640	139	11	229	649
Total	387	387	3888	3888	186	186	2940	2940	150	150	2251	2251

* 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