

Fecha de Publicación: 30 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 28 de Septiembre 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\$849,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,4%.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	112,5	76,2	24,0	40,0	7,2	27,5	45,0
15-35	365,3	206,9	136,4	279,1	2,5	18,3	68,0
36-60	24,8	21,4	15,0	0,0	6,4	24,8	0,0
61-90	22,9	4,4	0,0	0,0	4,4	22,9	0,0
91-180	5,2	7,9	0,0	0,0	7,9	5,2	0,0
>180	0,2	1,6	0,0	0,0	1,6	0,2	0,0
Total	530,9	318,4	175,4	319,1	30,0	98,8	113,0

* 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	0,2 %	0,7 %	5,7 %	2,9 %
15-35	0,4 %	3,1 %	0,1 %	1,1 %
36-60	-	0,6 %	0,3 %	0,4 %
61-90	-	1,1 %	0,3 %	0,4 %
91-180	-	1,6 %	0,5 %	1,1 %
>180	-	2,6 %	0,9 %	2,5 %
Total	0,3 %	2,4 %	1,2 %	1,4 %

*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	361	2332	2068	10	200	1904	1749	12	163	1719	1451
Intragrupa y off-shore***	0	0	1109	735	0	0	1029	607	0	0	964	761
Otros	361	10	584	1222	200	10	275	851	163	12	160	631
Total	371	371	4025	4025	210	210	3208	3208	174	174	2843	2843

* 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