

Fecha de Publicación: 4 de Octubre de 2010
Fecha de Información: 30 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\$912,5 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	55,7	60,0	53,0	16,0	7,0	39,7	0,0
15-35	232,5	312,3	229,5	114,4	20,8	56,1	62,0
36-60	53,5	4,1	0,0	0,0	4,1	53,5	0,0
61-90	32,5	46,5	35,0	0,0	11,5	32,5	0,0
91-180	34,5	48,2	0,0	0,0	38,2	24,5	10,0
>180	19,1	13,6	0,5	9,0	3,1	0,1	10,0
Total	427,8	484,7	318,0	139,4	84,7	206,4	82,0

* 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 %	0,5 %	0,4 %
15-35	-0,1 %	0,4 %	-0,1 %	0,2 %
36-60	-	1,3 %	-0,1 %	0,0 %
61-90	-	0,3 %	-0,1 %	0,1 %
91-180	0,1 %	1,5 %	0,5 %	0,9 %
>180	0,7 %	2,1 %	1,3 %	1,1 %
Total	0,0 %	0,5 %	0,1 %	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	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	363	2382	2081	14	200	2013	1789	12	165	1743	1496
Intragrupa y off-shore***	0	0	1134	785	0	0	1049	657	0	0	992	761
Otros	363	10	571	1222	200	14	295	911	165	12	177	656
Total	373	373	4088	4088	215	215	3356	3356	178	178	2913	2913

* 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