

Fecha de Publicación: 21 de Octubre de 2010
Fecha de Información: 19 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\$1185,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,9%.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	205,7	140,6	84,0	92,0	6,6	63,7	50,0
15-35	152,1	497,7	388,0	20,0	69,7	92,1	40,0
36-60	43,9	45,1	39,9	15,0	5,2	28,9	0,0
61-90	20,3	6,9	0,0	0,0	6,9	20,3	0,0
91-180	38,1	11,5	0,0	0,0	11,5	38,1	0,0
>180	19,6	4,2	0,0	12,0	4,2	7,6	0,0
Total	479,7	706,1	511,9	139,0	104,2	250,7	90,0

* 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 %	-0,4 %	-0,4 %	-0,4 %
15-35	-0,1 %	-0,3 %	-6,0 %	-1,3 %
36-60	-	-0,3 %	-0,7 %	-0,5 %
61-90	-	0,4 %	-0,8 %	-0,5 %
91-180	-	0,4 %	-0,1 %	0,0 %
>180	-	1,2 %	0,4 %	0,7 %
Total	-0,1 %	-0,3 %	-2,0 %	-0,9 %

* 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**	20	223	1638	1571	22	354	2126	1625	3	175	1554	1538
Intragrupa y off-shore***	0	0	993	461	4	0	850	899	0	0	910	570
Otros	222	20	296	895	350	22	324	777	175	3	215	571
Total	243	243	2927	2927	376	376	3301	3301	178	178	2679	2679

* 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