

Fecha de Publicación: 25 de Octubre de 2010
Fecha de Información: 21 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\$932,7 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	79,7	40,2	21,5	30,6	8,7	39,1	10,0
15-35	254,9	383,9	271,0	32,3	34,9	144,7	78,0
36-60	30,1	14,1	0,0	0,0	4,1	20,1	10,0
61-90	30,4	4,2	0,0	18,0	4,2	12,4	0,0
91-180	70,9	17,3	0,0	5,0	17,3	65,9	0,0
>180	5,3	1,7	0,0	3,5	1,7	1,8	0,0
Total	471,3	461,4	292,5	89,3	70,9	284,0	98,0

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

*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	219	1688	1580	27	354	2215	1706	7	175	1576	1550
Intragrupa y off-shore***	0	0	993	479	4	0	892	925	0	0	920	570
Otros	219	20	295	916	350	27	364	840	175	7	217	593
Total	239	239	2975	2975	381	381	3471	3471	182	182	2713	2713

* 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