

Fecha de Publicación: 26 de Octubre de 2010
Fecha de Información: 22 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\$754,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,0%.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	120,7	80,9	15,0	64,0	65,9	56,7	0,0
15-35	206,4	205,0	151,3	27,2	40,3	165,7	13,5
36-60	56,6	5,9	0,0	0,6	5,9	56,0	0,0
61-90	26,9	13,5	10,0	0,0	3,5	26,9	0,0
91-180	25,5	11,9	0,0	0,0	11,9	25,5	0,0
>180	0,7	0,1	0,0	0,0	0,1	0,7	0,0
Total	436,7	317,3	176,3	91,8	127,6	331,4	13,5

* 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	-	0,7 %	1,4 %	1,1 %
15-35	0,2 %	1,5 %	0,4 %	0,9 %
36-60	-	1,0 %	0,3 %	0,3 %
61-90	-	10,8 %	0,1 %	3,7 %
91-180	-	0,8 %	0,5 %	0,6 %
>180	-	3,7 %	1,3 %	1,7 %
Total	0,2 %	1,6 %	0,6 %	1,0 %

* 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	221	1688	1579	32	354	2301	1781	9	175	1603	1556
Intragrupa y off-shore***	0	0	993	479	4	0	907	979	0	0	920	580
Otros	220	20	294	916	350	32	424	872	175	9	223	610
Total	241	241	2975	2975	385	385	3632	3632	185	185	2746	2746

* 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