

Fecha de Publicación: 17 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 12 de Noviembre 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\$865,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,7%.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	92,1	79,1	27,0	30,0	52,1	62,1	0,0
15-35	236,1	188,0	100,5	126,0	74,5	97,1	13,0
36-60	7,2	24,8	0,0	0,5	24,8	6,7	0,0
61-90	13,2	102,2	0,0	0,0	102,2	13,2	0,0
91-180	56,4	37,7	10,0	5,0	17,7	41,4	10,0
>180	17,5	11,1	10,0	0,0	1,1	17,5	0,0
Total	422,5	442,9	147,5	161,5	272,4	238,0	23,0

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

*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	8 al 12 de Noviembre				15 al 19 de Noviembre				22 al 26 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	138	1943	1538	46	177	1694	1729	14	184	1815	1714
Intragrupa y off-shore***	0	0	834	762	0	0	1108	560	0	0	1077	458
Otros	138	28	394	871	177	46	279	792	184	14	227	947
Total	166	166	3171	3171	223	223	3081	3081	198	198	3119	3119

* 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