

Fecha de Publicación: 18 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 16 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\$1209,5 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	165,2	87,2	41,0	131,0	46,2	34,2	0,0
15-35	266,9	424,2	281,5	136,0	60,7	48,9	82,0
36-60	8,1	52,3	40,0	0,0	12,3	8,1	0,0
61-90	8,8	0,4	0,0	0,0	0,4	8,8	0,0
91-180	65,1	6,2	0,0	0,2	6,2	64,9	0,0
>180	57,5	67,5	54,7	0,0	2,4	47,2	10,3
Total	571,6	637,9	417,2	267,2	128,3	212,1	92,3

* 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 %	-1,1 %	-0,9 %
15-35	1,1 %	-0,3 %	-0,6 %	-0,2 %
36-60	-	-0,4 %	-1,5 %	-0,5 %
61-90	-	0,8 %	-1,0 %	-1,0 %
91-180	-	0,5 %	-0,4 %	-0,3 %
>180	0,0 %	1,3 %	0,7 %	0,8 %
Total	1,0 %	-0,3 %	-0,6 %	-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	15 al 19 de Noviembre				22 al 26 de Noviembre				29 de Nov. al 3 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	46	166	1812	1822	16	185	1858	1751	10	270	1722	1802
Intragrupa y off-shore***	0	0	1183	671	0	0	1077	478	0	0	1272	534
Otros	166	46	298	799	184	16	264	970	270	10	255	913
Total	212	212	3292	3292	200	200	3199	3199	280	280	3249	3249

* 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