

Fecha de Publicación: 24 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 22 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\$946,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,4%.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	253,8	68,7	1,0	236,0	57,7	7,8	10,0
15-35	136,6	324,9	264,0	92,0	35,9	19,6	25,0
36-60	13,6	10,4	0,0	0,0	10,4	13,6	0,0
61-90	13,7	2,9	0,0	0,0	2,9	13,7	0,0
91-180	107,4	4,8	0,0	0,0	4,8	107,4	0,0
>180	9,3	0,6	0,0	0,0	0,6	9,3	0,0
Total	534,4	412,3	265,0	328,0	112,3	171,4	35,0

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

* 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	22 al 26 de Noviembre				29 de Nov. al 3 de Diciembre				6 al 10 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	187	2344	1964	20	273	1957	1978	7	260	1398	964
Intragrupa y off-shore***	0	1	1145	890	0	0	1303	632	0	0	591	608
Otros	187	28	394	1029	273	20	354	1004	260	7	174	592
Total	216	216	3883	3883	293	293	3614	3614	267	267	2163	2163

* 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