

Fecha de Publicación: 4 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 02 de Noviembre 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\$1078,1 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	216,4	80,7	55,0	169,0	0,7	22,4	25,0
15-35	253,7	336,8	267,5	161,5	16,3	39,2	53,0
36-60	6,3	0,3	0,0	0,0	0,3	6,3	0,0
61-90	38,9	10,6	0,0	2,0	10,6	36,9	0,0
91-180	38,6	32,7	0,0	0,0	32,7	38,6	0,0
>180	17,9	45,1	40,0	0,0	5,1	17,9	0,0
Total	571,9	506,2	362,5	332,5	65,7	161,4	78,0

* 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 %	3,1 %	-0,2 %	0,7 %
15-35	0,0 %	0,1 %	-0,1 %	0,0 %
36-60	-	1,0 %	-0,9 %	-0,8 %
61-90	-	0,5 %	0,0 %	0,1 %
91-180	-	1,3 %	0,0 %	0,6 %
>180	-	1,2 %	0,9 %	1,1 %
Total	0,0 %	0,7 %	-0,1 %	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	1 al 5 de Noviembre				8 al 12 de Noviembre				15 al 19 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	174	2113	1854	21	140	1424	1356	17	177	1210	1529
Intragrupa y off-shore***	0	0	1005	920	0	0	810	420	0	0	1061	351
Otros	174	18	352	696	140	21	286	744	177	17	170	562
Total	192	192	3471	3471	160	160	2520	2520	193	193	2441	2441

* 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