

Fecha de Publicación: 5 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 03 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\$1052,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,6%.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	194,1	48,0	17,0	139,2	21,0	44,9	10,0
15-35	286,2	380,1	289,5	126,0	31,1	100,7	59,5
36-60	6,5	1,9	0,0	0,0	1,9	6,5	0,0
61-90	2,1	8,0	0,0	0,0	8,0	2,1	0,0
91-180	72,8	50,0	40,0	0,0	10,0	72,8	0,0
>180	2,6	0,1	0,0	0,0	0,1	2,6	0,0
Total	564,3	488,0	346,5	265,2	72,0	229,6	69,5

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

* 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	175	2201	1855	21	163	1502	1371	17	177	1263	1539
Intragrupa y off-shore***	0	0	1005	1001	0	0	827	463	0	0	1061	387
Otros	175	18	353	703	163	21	284	778	177	17	170	568
Total	193	193	3559	3559	184	184	2612	2612	194	194	2494	2494

* 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