

Fecha de Publicación: 9 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 05 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\$770,8 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	120,0	44,4	0,0	42,0	44,4	78,0	0,0
15-35	216,4	267,0	82,0	84,0	103,5	50,9	81,5
36-60	2,7	41,8	0,0	0,0	41,8	2,7	0,0
61-90	2,0	8,8	0,0	0,0	8,8	2,0	0,0
91-180	15,1	21,6	10,0	0,0	11,6	15,1	0,0
>180	13,5	17,7	0,0	0,0	7,7	3,5	10,0
Total	369,7	401,2	92,0	126,0	217,7	152,2	91,5

* 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	-	-0,8 %	-2,3 %	-1,9 %
15-35	-0,5 %	-0,1 %	-0,5 %	-0,3 %
36-60	-	-0,3 %	-1,2 %	-0,4 %
61-90	-	0,8 %	-1,1 %	0,4 %
91-180	-	0,3 %	0,0 %	0,2 %
>180	0,8 %	1,5 %	0,1 %	0,9 %
Total	-0,4 %	-0,2 %	-1,2 %	-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	166	2205	1864	26	134	1793	1512	21	178	1323	1567
Intragrupa y off-shore***	0	0	1005	1005	0	0	834	655	0	0	1077	393
Otros	166	18	362	703	134	26	387	848	178	21	178	618
Total	184	184	3572	3572	160	160	3014	3014	199	199	2578	2578

* 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