

Fecha de Publicación: 11 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 09 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\$1091,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,5%.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	155,1	68,6	11,0	42,1	7,6	63,0	50,0
15-35	320,9	365,0	134,4	102,0	116,6	104,9	114,0
36-60	2,0	23,8	15,0	0,0	8,8	2,0	0,0
61-90	16,4	10,0	0,0	0,0	10,0	16,4	0,0
91-180	53,9	54,8	50,0	0,0	4,8	53,9	0,0
>180	14,8	6,7	0,0	0,0	1,7	9,8	5,0
Total	563,0	528,9	210,4	144,1	149,5	249,9	169,0

* 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	-0,6 %	-1,6 %	-2,8 %	-1,9 %
15-35	0,7 %	-1,0 %	-0,4 %	-0,4 %
36-60	-	-0,6 %	-2,3 %	-0,8 %
61-90	-	0,5 %	-1,2 %	-0,5 %
91-180	-	2,6 %	-0,5 %	1,1 %
>180	0,0 %	1,3 %	0,4 %	0,4 %
Total	0,3 %	-0,4 %	-0,9 %	-0,5 %

*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	8 al 12 de Noviembre				15 al 19 de Noviembre				22 al 26 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	137	1968	1535	32	180	1387	1600	13	184	1705	1623
Intragrupa y off-shore***	0	0	834	762	0	0	1077	404	0	0	1056	447
Otros	137	31	390	895	180	32	201	661	184	13	185	875
Total	168	168	3192	3192	212	212	2665	2665	197	197	2945	2945

* 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