

Fecha de Publicación: 12 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 10 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\$1073,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,1%.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	201,7	24,1	0,0	119,0	24,1	82,7	0,0
15-35	253,9	306,4	228,5	132,5	36,4	79,9	41,5
36-60	45,3	2,0	0,0	40,7	2,0	4,6	0,0
61-90	36,2	67,5	0,0	0,7	67,4	35,5	0,1
91-180	38,5	33,2	10,0	0,7	23,2	37,9	0,0
>180	47,8	16,9	10,0	0,0	1,9	42,8	5,0
Total	623,4	450,1	248,5	293,5	155,0	283,3	46,6

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

* 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	1997	1535	40	180	1533	1609	14	184	1750	1646
Intragrupa y off-shore***	0	0	834	762	0	0	1077	523	0	0	1056	447
Otros	137	31	391	924	180	40	210	688	184	14	208	920
Total	169	169	3221	3221	220	220	2820	2820	198	198	3014	3014

* 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