

Fecha de Publicación: 19 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 17 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\$1337,3 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	285,0	94,9	30,0	249,0	64,9	36,0	0,0
15-35	212,2	438,0	334,3	143,0	62,7	28,2	41,0
36-60	3,4	22,7	0,0	0,0	22,7	3,4	0,0
61-90	40,7	44,9	0,5	0,0	44,4	40,7	0,0
91-180	74,3	3,2	0,0	0,0	3,2	74,3	0,0
>180	43,9	74,1	72,0	32,1	2,1	11,8	0,0
Total	659,5	677,8	436,8	424,1	200,0	194,4	41,0

* 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	-	-1,4 %	0,5 %	0,0 %
15-35	-0,8 %	-0,9 %	-1,6 %	-1,1 %
36-60	-	-0,6 %	-2,1 %	-0,8 %
61-90	-	-0,1 %	-1,2 %	-0,6 %
91-180	-	1,0 %	-0,1 %	0,0 %
>180	-	0,6 %	0,1 %	0,2 %
Total	-0,8 %	-0,9 %	-0,4 %	-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	15 al 19 de Noviembre				22 al 26 de Noviembre				29 de Nov. al 3 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	46	168	2008	1821	17	186	1868	1824	11	270	1820	1857
Intragrupa y off-shore***	0	0	1183	868	0	0	1107	478	0	0	1302	586
Otros	168	46	297	798	186	17	308	980	270	11	275	954
Total	214	214	3487	3487	203	203	3282	3282	281	281	3397	3397

* 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