

Fecha de Publicación: 19 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 18 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\$1466,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	323,0	127,7	38,0	248,4	61,7	46,5	28,0
15-35	169,5	586,6	496,0	125,0	59,6	13,5	31,0
36-60	1,3	36,7	0,0	0,0	36,7	1,3	0,0
61-90	26,3	28,3	10,0	0,0	18,3	26,3	0,0
91-180	106,1	18,3	5,0	0,0	13,3	106,1	0,0
>180	12,5	30,3	30,0	0,0	0,3	12,5	0,0
Total	638,7	827,8	579,0	373,4	189,8	206,2	59,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,2 %	-0,9 %	-0,4 %	-0,3 %
15-35	-0,7 %	-0,9 %	0,0 %	-0,7 %
36-60	-	-0,3 %	-1,7 %	-0,4 %
61-90	-	-0,3 %	-1,5 %	-0,9 %
91-180	-	0,1 %	-0,1 %	0,0 %
>180	-	3,2 %	0,4 %	2,3 %
Total	1,2 %	-0,6 %	-0,3 %	-0,4 %

*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**	44	168	2034	1822	25	186	2125	1930	13	273	1876	1920
Intragruppo y off-shore***	0	0	1183	894	0	1	1145	690	0	0	1302	596
Otros	168	44	297	798	186	24	361	1010	273	13	307	969
Total	213	213	3514	3514	212	212	3631	3631	286	286	3485	3485

* 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 intragruppo