

Fecha de Publicación: 23 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 19 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\$469,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1.5%.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	55,8	23,3	0,0	0,0	23,3	55,8	0,0
15-35	179,2	85,6	23,0	99,0	23,6	41,2	39,0
36-60	1,7	6,1	0,0	0,0	6,1	1,7	0,0
61-90	25,4	20,5	0,0	0,0	20,5	25,4	0,0
91-180	24,5	15,3	0,0	0,7	15,3	23,8	0,0
>180	4,3	27,6	25,0	0,0	2,6	4,3	0,0
Total	290,8	178,4	48,0	99,7	91,4	152,2	39,0

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

* 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	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	2038	1821	29	185	2145	1945	17	273	1905	1929
Intragrupa y off-shore***	0	0	1183	898	0	1	1145	690	0	0	1302	596
Otros	168	44	296	798	185	28	376	1030	273	17	317	998
Total	213	213	3517	3517	215	215	3665	3665	290	290	3523	3523

* 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