

Fecha de Publicación: 26 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 24 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\$1267,8 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	151,8	125,9	6,5	83,0	89,4	38,8	30,0
15-35	313,3	376,0	255,0	188,5	17,6	21,4	103,4
36-60	2,5	18,0	0,0	0,0	18,0	2,5	0,0
61-90	20,9	4,4	0,0	0,0	4,4	20,9	0,0
91-180	71,1	26,3	25,0	5,0	1,3	66,1	0,0
>180	58,0	99,5	70,0	0,0	1,5	30,0	28,0
Total	617,7	650,2	356,5	276,5	132,3	179,8	161,4

* 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	-5,4 %	-1,2 %	-1,4 %	-1,8 %
15-35	1,2 %	-0,7 %	0,1 %	0,0 %
36-60	-	-0,9 %	-2,5 %	-1,1 %
61-90	-	0,7 %	-0,6 %	-0,4 %
91-180	-	0,0 %	-0,3 %	-0,2 %
>180	0,4 %	0,3 %	0,1 %	0,2 %
Total	-0,1 %	-0,7 %	-0,5 %	-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	22 al 26 de Noviembre				29 de Nov. al 3 de Diciembre				6 al 10 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	186	2515	2043	21	317	2091	2070	8	260	1437	1023
Intragrupa y off-shore***	0	1	1170	1035	0	0	1313	647	0	0	601	608
Otros	185	28	431	1039	317	21	394	1081	260	8	202	611
Total	214	214	4116	4116	338	338	3798	3798	268	268	2241	2241

* 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