

Fecha de Publicación: 30 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 26 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\$1036,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,2%.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	79,1	70,2	30,0	30,0	5,2	14,1	35,0
15-35	225,5	344,7	241,0	141,0	45,6	26,4	58,1
36-60	76,8	53,6	25,0	0,0	18,6	66,8	10,0
61-90	31,6	28,7	0,0	0,5	8,7	11,1	20,0
91-180	82,5	1,7	0,0	0,0	1,7	82,5	0,0
>180	24,7	17,5	10,0	3,0	7,5	21,6	0,1
Total	520,2	516,4	306,0	174,5	87,3	222,5	123,2

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

* 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**	28	186	2515	2042	22	318	2129	2102	13	260	1479	1064
Intragrupa y off-shore***	0	1	1170	1035	0	0	1313	647	0	0	631	638
Otros	186	26	430	1039	318	22	401	1094	260	13	203	613
Total	214	214	4116	4116	340	340	3843	3843	272	272	2314	2314

* 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