

Fecha de Publicación: 25 de Noviembre de 2010
Fecha de Información: 23 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\$1209,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,2%.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	165,3	101,5	39,0	76,5	33,5	59,8	29,0
15-35	244,3	446,9	278,5	97,6	43,3	21,6	125,1
36-60	41,7	0,6	0,0	0,0	0,6	41,6	0,0
61-90	16,4	5,5	0,0	1,2	5,5	15,2	0,0
91-180	114,7	10,8	0,0	28,0	3,8	79,7	7,0
>180	22,0	40,0	20,0	0,0	19,9	21,9	0,1
Total	604,5	605,2	337,5	203,3	106,5	240,0	161,2

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-0,9 %	-6,4 %	-0,1 %	-2,0 %
15-35	-0,7 %	-0,5 %	-4,0 %	-1,3 %
36-60	-	-0,7 %	-1,9 %	-1,9 %
61-90	-	-0,2 %	-1,2 %	-1,0 %
91-180	-0,4 %	0,4 %	-0,4 %	-0,4 %
>180	0,5 %	1,2 %	0,1 %	0,8 %
Total	-0,7 %	-1,2 %	-1,4 %	-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**	29	188	2440	2029	20	273	2025	2003	7	260	1426	1019
Intragruppo y off-shore***	0	1	1164	962	0	0	1313	637	0	0	601	608
Otros	188	28	423	1037	273	20	357	1055	260	7	198	599
Total	217	217	4027	4027	293	293	3695	3695	267	267	2225	2225

* 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 intragruppo