

Fecha de Publicación: 2 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 30 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\$1327,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,7%.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	201,0	208,8	124,0	161,5	71,8	26,5	13,0
15-35	282,7	361,5	253,8	186,8	68,2	56,4	39,5
36-60	76,3	30,4	10,0	0,0	20,4	76,3	0,0
61-90	52,7	13,1	0,0	3,0	13,1	49,7	0,0
91-180	15,6	25,5	0,0	0,0	25,5	15,6	0,0
>180	21,5	38,2	0,0	0,0	32,2	15,5	6,0
Total	649,8	677,5	387,8	351,3	231,3	240,0	58,5

* 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	-24,4 %	-2,9 %	-1,0 %	-3,1 %
15-35	0,4 %	-0,3 %	-3,2 %	-1,5 %
36-60	-	-1,4 %	-3,1 %	-2,6 %
61-90	-	-0,6 %	0,5 %	0,3 %
91-180	-	0,5 %	-0,9 %	0,0 %
>180	0,2 %	0,8 %	-0,2 %	0,4 %
Total	-5,2 %	-1,0 %	-2,1 %	-1,7 %

* 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	29 de Nov. al 3 de Diciembre				6 al 10 de Diciembre				13 al 17 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	256	2417	2306	17	263	1539	1178	23	384	1561	2119
Intragrupa y off-shore***	0	0	1411	921	0	0	676	640	0	0	1647	728
Otros	256	26	507	1108	263	17	252	649	384	23	203	564
Total	282	282	4335	4335	280	280	2467	2467	406	406	3411	3411

* 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