

Fecha de Publicación: 7 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 03 de Diciembre 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\$850,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -2,5%.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	80,5	78,6	11,1	28,0	36,0	21,0	31,5
15-35	205,6	239,7	133,0	147,5	51,3	2,7	55,4
36-60	78,0	21,9	0,0	0,0	16,9	73,0	5,0
61-90	37,2	7,2	0,0	0,0	7,2	37,2	0,0
91-180	24,2	6,2	0,0	0,0	6,2	24,2	0,0
>180	66,2	5,0	0,0	9,4	5,0	56,8	0,0
Total	491,6	358,6	144,1	184,9	122,6	214,9	91,9

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

* 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	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**	25	249	2445	2337	25	265	1661	1333	38	390	1707	2247
Intragrupa y off-shore***	0	0	1416	929	0	2	736	675	0	0	1714	819
Otros	249	25	512	1108	265	23	323	712	390	38	212	568
Total	274	274	4374	4374	290	290	2720	2720	428	428	3633	3633

* 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