

Fecha de Publicación: 13 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 09 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\$1083,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -4,7%.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	85,3	35,3	12,0	47,5	8,3	22,8	15,0
15-35	352,6	386,5	115,0	154,7	80,5	6,8	191,0
36-60	2,2	37,2	22,6	0,7	14,6	1,6	0,0
61-90	29,1	10,3	0,0	0,6	10,3	28,6	0,0
91-180	64,9	15,8	15,0	15,9	0,8	49,0	0,0
>180	33,9	30,0	30,0	0,0	0,0	33,9	0,0
Total	567,9	515,0	194,6	219,4	114,5	142,6	206,0

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

* 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	6 al 10 de Diciembre				13 al 17 de Diciembre				20 al 24 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	257	1798	1545	47	396	2107	2368	9	240	1110	1476
Intragrupa y off-shore***	0	2	889	751	3	0	1747	1123	0	0	1049	621
Otros	257	33	332	723	393	47	250	613	240	9	217	278
Total	292	292	3019	3019	443	443	4104	4104	249	249	2376	2376

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo