

Fecha de Publicación: 14 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 10 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\$1086,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -4,5%.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	157,8	101,6	14,5	79,5	32,1	23,3	55,0
15-35	172,2	408,8	301,8	162,0	102,0	5,2	5,0
36-60	21,3	4,4	0,0	20,0	4,4	1,3	0,0
61-90	4,8	3,1	0,0	0,0	3,1	4,8	0,0
91-180	68,5	52,2	20,0	0,0	32,2	68,5	0,0
>180	51,7	40,5	40,0	0,0	0,5	51,7	0,0
Total	476,2	610,4	376,3	261,5	174,1	154,7	60,0

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

* 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	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	248	1798	1545	48	398	2218	2410	10	241	1154	1533
Intragrupa y off-shore***	0	2	889	751	3	0	1762	1202	0	0	1049	621
Otros	248	33	332	724	395	48	258	626	241	10	237	286
Total	283	283	3019	3019	447	447	4238	4238	251	251	2440	2440

* 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