

Fecha de Publicación: 16 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 14 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\$977,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -5,4%.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	224,6	184,2	146,0	188,7	8,2	5,9	30,0
15-35	128,8	332,9	295,2	111,0	25,7	5,8	12,0
36-60	8,4	10,3	0,0	0,0	10,3	8,4	0,0
61-90	12,6	29,4	22,0	0,0	1,4	6,6	6,0
91-180	3,4	5,4	0,0	0,0	5,4	3,4	0,0
>180	29,2	7,9	5,0	10,0	2,9	19,2	0,0
Total	406,9	570,1	468,2	309,7	53,9	49,2	48,0

* 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	-5,1 %	-4,9 %	-2,9 %	-3,8 %
15-35	-8,3 %	-6,2 %	-9,2 %	-7,2 %
36-60	-	-7,3 %	-10,4 %	-8,7 %
61-90	-5,1 %	-3,7 %	-4,7 %	-4,1 %
91-180	-	0,1 %	-3,0 %	-1,1 %
>180	-	0,8 %	-0,9 %	-0,6 %
Total	-5,9 %	-5,5 %	-5,2 %	-5,4 %

* 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	13 al 17 de Diciembre				20 al 24 de Diciembre				27 al 31 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	390	2508	2472	14	254	1246	1670	4	455	1506	1725
Intragrupa y off-shore***	3	0	1804	1464	0	0	1170	692	0	0	1066	749
Otros	387	44	261	636	254	14	243	297	455	4	204	303
Total	434	434	4572	4572	268	268	2659	2659	459	459	2777	2777

* 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