

Fecha de Publicación: 17 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 15 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\$1017,4 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	279,0	53,1	25,0	243,0	6,1	14,0	22,0
15-35	137,8	196,6	139,5	134,0	54,1	0,8	3,0
36-60	7,4	7,1	0,0	0,0	1,1	1,4	6,0
61-90	40,1	213,2	175,0	0,0	3,2	5,1	35,0
91-180	20,1	3,4	0,0	0,0	3,4	20,1	0,0
>180	26,5	33,2	30,0	15,0	3,2	11,5	0,0
Total	510,9	506,5	369,5	392,0	71,0	52,9	66,0

* 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	-13,3 %	-9,5 %	-2,4 %	-4,0 %
15-35	-11,9 %	-9,5 %	-10,3 %	-9,9 %
36-60	-8,8 %	-2,6 %	-6,2 %	-7,6 %
61-90	-5,1 %	0,9 %	-4,7 %	-0,2 %
91-180	-	-0,3 %	-3,1 %	-2,7 %
>180	-	0,1 %	-1,6 %	-1,3 %
Total	-8,5 %	-4,0 %	-4,7 %	-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	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	389	2530	2472	14	259	1418	1694	4	455	1595	1748
Intragrupa y off-shore***	3	0	1804	1476	0	0	1180	844	0	0	1081	833
Otros	386	44	260	647	259	14	240	300	455	4	208	304
Total	433	433	4595	4595	273	273	2837	2837	460	460	2884	2884

* 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