

Fecha de Publicación: 20 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 16 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\$1084,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -5,6%.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	197,9	123,7	67,0	140,0	18,7	19,9	38,0
15-35	167,6	486,7	319,9	33,0	63,9	31,8	102,8
36-60	3,1	9,0	0,0	0,0	9,0	3,1	0,0
61-90	30,2	5,7	0,0	20,0	3,8	8,3	1,9
91-180	7,4	22,9	20,0	0,0	2,9	7,4	0,0
>180	28,9	0,9	0,0	15,0	0,9	13,9	0,0
Total	435,1	648,9	406,9	208,0	99,2	84,4	142,7

* 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	-10,0 %	-7,2 %	-0,5 %	-4,0 %
15-35	-7,9 %	-5,7 %	-13,3 %	-7,1 %
36-60	-	-8,3 %	-10,5 %	-8,8 %
61-90	-5,7 %	-1,3 %	-2,9 %	-2,9 %
91-180	-	-1,3 %	-1,5 %	-1,4 %
>180	-	1,3 %	-0,8 %	-0,7 %
Total	-8,4 %	-5,6 %	-3,9 %	-5,6 %

* 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**	43	394	2537	2483	14	260	1464	1754	5	460	1747	1803
Intragrupa y off-shore***	3	0	1811	1476	0	0	1217	866	0	0	1109	956
Otros	391	43	265	654	260	14	251	312	460	5	209	305
Total	437	437	4613	4613	273	273	2932	2932	465	465	3064	3064

* 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