

Fecha de Publicación: 23 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 21 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\$851,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -3,7%.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	139,0	33,0	0,0	113,0	23,0	16,0	10,0
15-35	198,8	240,3	159,5	143,0	29,8	4,8	51,0
36-60	10,9	1,8	0,0	5,0	1,8	5,9	0,0
61-90	10,7	55,9	55,0	0,0	0,9	10,7	0,0
91-180	5,3	3,2	0,0	0,0	3,2	5,3	0,0
>180	47,3	104,5	65,0	0,0	4,5	12,3	35,0
Total	412,2	438,8	279,5	261,0	63,3	55,2	96,0

* 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	-16,7 %	-11,5 %	-4,3 %	-8,0 %
15-35	-3,6 %	-6,6 %	-4,0 %	-4,9 %
36-60	-	-2,3 %	-12,1 %	-10,7 %
61-90	-	-4,9 %	-7,8 %	-5,3 %
91-180	-	-1,1 %	-3,5 %	-2,6 %
>180	7,8 %	6,1 %	-1,1 %	5,8 %
Total	-0,8 %	-4,1 %	-4,5 %	-3,7 %

* 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	20 al 24 de Diciembre				27 al 31 de Diciembre				3 al 7 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	303	1722	1716	6	467	1872	1891	9	124	978	1290
Intragrupa y off-shore***	0	0	1217	1092	0	0	1149	1025	0	0	710	410
Otros	303	15	214	344	467	6	227	333	124	9	340	328
Total	318	318	3152	3152	473	473	3249	3249	133	133	2028	2028

* 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