

Fecha de Publicación: 27 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 23 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\$630,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -10%.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	124,0	64,7	50,5	105,0	11,2	16,0	3,0
15-35	97,0	186,0	138,0	54,5	16,5	11,0	31,5
36-60	1,3	50,7	40,0	0,0	10,7	1,3	0,0
61-90	0,5	9,3	0,0	0,0	9,3	0,5	0,0
91-180	11,2	61,8	61,0	0,0	0,8	11,2	0,0
>180	13,8	10,1	10,0	0,0	0,1	13,8	0,0
Total	247,8	382,6	299,5	159,5	48,6	53,8	34,5

* 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	-19,5 %	-13,4 %	-11,2 %	-12,2 %
15-35	-14,3 %	-13,0 %	-7,5 %	-11,7 %
36-60	-	-7,9 %	-15,5 %	-8,7 %
61-90	-	-0,9 %	-10,7 %	-1,4 %
91-180	-	-3,5 %	-5,9 %	-3,8 %
>180	-	-2,8 %	-2,8 %	-2,8 %
Total	-14,8 %	-10,1 %	-8,8 %	-10,0 %

* 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	300	1744	1720	6	473	1990	1953	11	126	1043	1348
Intragrupa y off-shore***	0	0	1217	1108	0	0	1176	1125	0	0	761	465
Otros	300	15	218	350	473	6	263	351	126	11	344	335
Total	315	315	3178	3178	479	479	3429	3429	137	137	2148	2148

* 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