

Fecha de Publicación: 1 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 29 de Noviembre 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\$1340,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -2,1%.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	178,6	119,9	50,0	119,5	61,9	51,1	8,0
15-35	262,0	405,9	313,0	129,0	49,9	90,0	43,0
36-60	114,4	34,2	0,0	2,5	9,2	86,9	25,0
61-90	39,6	11,1	10,0	0,0	1,1	39,6	0,0
91-180	56,7	1,7	0,1	0,0	1,6	56,7	0,0
>180	23,7	92,3	90,0	0,0	2,3	23,7	0,0
Total	675,0	665,1	463,1	251,0	126,0	348,0	76,0

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

* 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	29 de Nov. al 3 de Diciembre				6 al 10 de Diciembre				13 al 17 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	255	2255	2201	16	262	1504	1122	23	383	1542	2062
Intragrupa y off-shore***	0	0	1323	762	0	0	658	638	0	0	1620	728
Otros	255	26	490	1105	262	16	227	630	383	23	186	558
Total	281	281	4068	4068	278	278	2389	2389	406	406	3348	3348

* 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