

Fecha de Publicación: 3 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 01 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\$716,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -4%.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	154,5	116,4	49,0	82,4	43,4	48,1	24,0
15-35	171,3	137,1	40,5	96,5	57,6	35,8	39,0
36-60	12,0	46,6	40,0	0,0	6,6	12,0	0,0
61-90	16,6	4,1	0,0	0,0	4,1	16,6	0,0
91-180	29,8	3,0	0,0	0,0	3,0	29,8	0,0
>180	23,6	1,5	0,0	2,9	1,5	20,7	0,0
Total	407,8	308,7	129,5	181,8	116,2	163,0	63,0

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

* 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	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	2437	2327	25	262	1602	1249	29	385	1621	2170
Intragrupa y off-shore***	0	0	1411	921	0	2	703	660	0	0	1669	788
Otros	255	26	508	1108	262	23	292	688	385	29	232	564
Total	281	281	4357	4357	287	287	2598	2598	413	413	3522	3522

* 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