

Fecha de Publicación: 6 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 02 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\$999,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -3,8%.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	74,2	122,6	72,0	23,0	10,6	11,2	40,0
15-35	120,7	379,2	111,5	22,0	208,7	39,7	59,0
36-60	39,7	74,0	34,0	10,0	40,0	29,7	0,0
61-90	58,5	16,1	0,0	5,0	16,1	53,5	0,0
91-180	80,6	13,9	10,1	50,0	3,8	30,6	0,0
>180	19,9	0,3	0,0	7,9	0,3	12,0	0,0
Total	393,6	606,0	227,6	117,9	279,4	176,7	99,0

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

* 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**	25	254	2445	2334	26	263	1632	1295	30	385	1662	2214
Intragrupa y off-shore***	0	0	1416	929	0	2	734	675	0	0	1705	791
Otros	254	25	509	1108	263	23	302	698	385	30	204	567
Total	278	278	4370	4370	288	288	2668	2668	415	415	3571	3571

* 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