

Fecha de Publicación: 22 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 20 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\$632,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -8,3%.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	79,6	58,4	35,0	55,0	19,4	20,6	4,0
15-35	134,1	248,4	164,0	56,0	19,4	13,1	65,0
36-60	11,4	24,3	11,0	0,0	8,3	6,4	5,0
61-90	4,2	0,1	0,0	3,0	0,1	1,2	0,0
91-180	47,6	1,8	0,0	21,0	1,8	26,6	0,0
>180	18,8	4,1	0,0	0,0	0,1	14,8	4,0
Total	295,6	337,2	210,0	135,0	49,2	82,6	78,0

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

* 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	1605	1715	6	467	1853	1881	9	125	951	1272
Intragrupa y off-shore***	0	0	1217	979	0	0	1149	1025	0	0	723	390
Otros	303	15	212	340	467	6	228	324	125	9	310	321
Total	318	318	3033	3033	473	473	3230	3230	133	133	1983	1983

* 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