

Fecha de Publicación: 29 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 27 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\$658,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -9,9%.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	122,7	151,1	60,0	32,0	14,1	13,7	77,0
15-35	131,7	151,4	40,0	56,0	40,4	4,7	71,0
36-60	0,7	0,2	0,0	0,0	0,2	0,7	0,0
61-90	0,7	36,7	35,0	0,0	1,7	0,7	0,0
91-180	38,2	0,4	0,0	5,0	0,4	33,2	0,0
>180	5,6	19,0	0,0	0,0	19,0	5,6	0,0
Total	299,7	358,7	135,0	93,0	75,7	58,7	148,0

* 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	-20,9 %	-7,3 %	-22,1 %	-18,3 %
15-35	-9,9 %	-15,6 %	-1,5 %	-9,6 %
36-60	-	-0,3 %	-14,5 %	-11,9 %
61-90	-	13,6 %	-10,3 %	13,1 %
91-180	-	-1,3 %	-5,3 %	-5,2 %
>180	-	1,4 %	-3,2 %	0,4 %
Total	-15,6 %	-5,4 %	-9,1 %	-9,9 %

* 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	27 al 31 de Diciembre				3 al 7 de Enero				10 al 14 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	6	467	2114	2091	11	126	1079	1363	1	60	237	350
Intragrupa y off-shore***	0	0	1236	1168	0	0	761	487	0	0	184	94
Otros	467	6	264	355	126	11	358	349	60	1	123	100
Total	472	472	3613	3613	137	137	2198	2198	61	61	543	543

* 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