

Fecha de Publicación: 30 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 28 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\$362,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -21,3%.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	68,7	88,2	65,0	15,5	1,2	31,2	22,0
15-35	75,0	95,4	29,0	39,0	46,4	16,0	20,0
36-60	3,7	19,3	0,0	0,0	19,3	3,7	0,0
61-90	1,0	3,5	0,0	0,0	3,5	1,0	0,0
91-180	1,5	1,3	0,0	0,0	1,3	1,5	0,0
>180	3,7	0,9	0,0	0,0	0,9	3,7	0,0
Total	153,7	208,6	94,0	54,5	72,6	57,2	42,0

* 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	-21,0 %	-9,6 %	-19,0 %	-19,7 %
15-35	-17,8 %	-22,4 %	-26,8 %	-23,0 %
36-60	-	-22,3 %	-23,4 %	-22,4 %
61-90	-	-2,4 %	-17,7 %	-5,8 %
91-180	-	-0,9 %	-11,5 %	-6,7 %
>180	-	0,4 %	-5,3 %	-4,2 %
Total	-19,5 %	-21,1 %	-22,5 %	-21,3 %

* 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	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	459	2158	2143	11	126	1133	1400	26	248	1116	1780
Intragrupa y off-shore***	0	0	1286	1182	0	0	776	489	0	0	1238	509
Otros	459	6	266	385	126	11	358	379	248	26	308	373
Total	465	465	3709	3709	137	137	2268	2268	274	274	2662	2662

* 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