

Fecha de Publicación: 31 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 29 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\$634,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -14%.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	136,3	57,8	6,0	62,0	19,8	42,3	32,0
15-35	54,0	276,3	209,8	14,0	34,5	8,0	32,0
36-60	2,5	39,8	0,0	0,0	39,8	2,5	0,0
61-90	0,5	12,3	5,0	0,0	7,3	0,5	0,0
91-180	35,5	10,8	5,0	0,0	5,8	35,5	0,0
>180	0,5	8,5	1,0	0,0	7,5	0,5	0,0
Total	229,2	405,5	226,8	76,0	114,7	89,2	64,0

* 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	-16,1 %	-16,1 %	-12,3 %	-13,7 %
15-35	4,6 %	-18,6 %	-29,1 %	-15,7 %
36-60	-	-12,3 %	-29,2 %	-13,3 %
61-90	-	-10,1 %	-18,0 %	-10,4 %
91-180	-	-7,0 %	-14,3 %	-12,6 %
>180	-	-0,1 %	-2,8 %	-0,3 %
Total	-5,8 %	-15,4 %	-15,3 %	-14,0 %

* 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	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	452	2178	2145	11	126	1249	1452	26	248	1120	1785
Intragrupa y off-shore***	0	0	1286	1202	0	0	782	531	0	0	1238	512
Otros	452	6	268	385	126	11	373	422	248	26	313	374
Total	457	457	3732	3732	138	138	2404	2404	274	274	2671	2671

* 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