

Fecha de Publicación: 12 de Enero de 2011
Fecha de Información: 07 de Enero de 2011 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\$1183,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -6,9%.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	406,8	27,3	10,5	384,0	13,8	19,8	3,0
15-35	162,4	383,7	286,0	81,5	42,7	25,9	55,0
36-60	15,8	85,5	54,1	5,0	31,4	10,8	0,0
61-90	63,2	27,3	0,0	0,0	7,3	43,2	20,0
91-180	0,5	8,3	0,0	0,0	8,3	0,5	0,0
>180	0,8	1,5	0,0	0,0	1,5	0,8	0,0
Total	649,5	533,6	350,6	470,6	105,0	100,9	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	-7,5 %	-2,6 %	-11,3 %	-10,6 %
15-35	-6,3 %	-5,1 %	-7,4 %	-5,8 %
36-60	-	-4,3 %	-3,9 %	-4,2 %
61-90	7,3 %	-0,8 %	-3,3 %	0,0 %
91-180	-	-0,6 %	-3,4 %	-0,7 %
>180	-	0,2 %	-2,1 %	-0,6 %
Total	-2,9 %	-4,6 %	-9,4 %	-6,9 %

* 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	3 al 7 de Enero				10 al 14 de Enero				17 al 21 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	70	1613	1619	31	217	1873	1895	3	232	1310	1503
Intragrupa y off-shore***	0	0	788	777	0	1	1261	1187	0	0	952	444
Otros	70	14	425	431	217	30	364	416	232	3	303	618
Total	85	85	2827	2827	248	248	3498	3498	236	236	2565	2565

* 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