

Fecha de Publicación: 5 de Enero de 2011
Fecha de Información: 03 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\$426,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -8,2%.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	127,0	91,4	0,0	36,0	0,9	0,5	90,5
15-35	63,2	110,6	61,6	31,0	34,0	17,2	15,0
36-60	0,1	0,9	0,0	0,0	0,9	0,1	0,0
61-90	13,0	0,1	0,0	0,0	0,1	13,0	0,0
91-180	11,3	2,2	0,0	0,0	2,2	11,3	0,0
>180	6,9	0,0	0,0	0,0	0,0	6,9	0,0
Total	221,5	205,2	61,6	67,0	38,0	49,0	105,5

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

* 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**	11	97	1395	1577	29	251	1135	1797	3	232	1115	1347
Intragrupa y off-shore***	0	0	788	581	0	0	1243	512	0	0	883	353
Otros	97	11	398	423	251	29	317	386	232	3	257	555
Total	108	108	2581	2581	280	280	2695	2695	235	235	2255	2255

* 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