

Fecha de Publicación: 7 de Enero de 2011
Fecha de Información: 05 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\$1393,4 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	402,8	77,7	5,0	335,0	32,7	27,8	40,0
15-35	102,1	365,5	300,5	56,0	39,0	20,1	26,0
36-60	40,0	227,5	184,0	40,0	43,5	0,0	0,0
61-90	117,4	27,1	0,0	40,0	7,1	57,4	20,0
91-180	10,0	7,4	0,0	0,0	7,4	10,0	0,0
>180	13,6	2,2	0,0	5,0	2,2	8,6	0,0
Total	685,9	707,5	489,5	476,0	131,9	123,9	86,0

* 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	-8,0 %	-12,6 %	-10,4 %	-10,4 %
15-35	-12,4 %	-10,3 %	-14,0 %	-10,8 %
36-60	-	-11,9 %	-5,1 %	-10,9 %
61-90	-5,6 %	-3,1 %	-6,3 %	-6,0 %
91-180	-	0,3 %	-2,0 %	-1,0 %
>180	-	-0,1 %	-0,6 %	-0,5 %
Total	-8,8 %	-10,8 %	-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	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	74	1607	1613	31	246	1497	1851	3	232	1212	1451
Intragrupa y off-shore***	0	0	788	772	0	1	1248	840	0	0	944	375
Otros	74	14	419	429	246	29	341	394	232	3	274	604
Total	89	89	2814	2814	277	277	3085	3085	236	236	2430	2430

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo