

Fecha de Publicación: 14 de Enero de 2011
Fecha de Información: 12 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\$1104,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -5,3%.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	95,3	150,6	92,0	59,6	34,6	11,7	24,0
15-35	152,3	276,4	88,5	82,0	164,4	46,8	23,5
36-60	101,5	115,4	0,0	50,0	65,4	1,5	50,0
61-90	75,5	19,0	0,0	15,0	19,0	60,5	0,0
91-180	41,8	15,0	0,0	0,1	15,0	41,8	0,0
>180	12,4	48,8	0,0	0,0	40,8	4,4	8,0
Total	478,9	625,2	180,5	206,7	339,2	166,8	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	-3,9 %	-2,9 %	-2,9 %	-3,0 %
15-35	-5,6 %	-9,0 %	-7,5 %	-8,4 %
36-60	-2,7 %	-9,0 %	-2,8 %	-5,2 %
61-90	-	-1,6 %	-2,9 %	-2,7 %
91-180	-	-0,5 %	-2,6 %	-2,0 %
>180	0,9 %	0,5 %	-0,6 %	0,5 %
Total	-3,4 %	-6,4 %	-4,4 %	-5,3 %

* 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	10 al 14 de Enero				17 al 21 de Enero				24 al 28 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	115	2073	2117	4	240	1452	1618	7	201	963	1091
Intragrupa y off-shore***	0	1	1373	1363	0	0	965	523	0	0	640	206
Otros	115	35	455	421	240	4	352	628	201	7	273	578
Total	151	151	3901	3901	244	244	2769	2769	208	208	1876	1876

* 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