

Fecha de Publicación: 18 de Enero de 2011
Fecha de Información: 14 de Enero de 2011¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$671,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -7,0%.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	96,2	80,1	59,0	68,0	21,1	28,3	0,0
15-35	155,9	210,0	55,3	56,6	132,2	76,8	22,5
36-60	0,9	4,3	0,0	0,0	4,3	0,9	0,0
61-90	18,7	40,1	0,0	3,0	40,1	15,7	0,0
91-180	21,2	2,7	0,0	4,0	2,7	17,2	0,0
>180	13,7	27,9	20,0	7,0	7,9	6,7	0,0
Total	306,6	365,1	134,2	138,6	208,3	145,6	22,5

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

* 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	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	91	2101	2144	5	195	1602	1737	7	201	996	1160
Intragrupa y off-shore***	0	1	1380	1381	0	0	1009	632	0	0	677	216
Otros	91	35	465	421	195	5	407	648	201	7	294	591
Total	128	128	3946	3946	200	200	3018	3018	208	208	1967	1967

* 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