

Fecha de Publicación: 19 de Enero de 2011
Fecha de Información: 17 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\$335,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -6,5%.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	95,7	36,2	27,8	72,0	0,4	15,7	8,0
15-35	18,0	62,1	62,0	17,8	0,1	0,2	0,0
36-60	0,7	59,7	32,0	0,0	27,7	0,7	0,0
61-90	5,2	0,2	0,0	0,0	0,2	5,2	0,0
91-180	47,8	9,4	0,0	20,0	9,4	27,8	0,0
>180	0,0	0,2	0,0	0,0	0,2	0,0	0,0
Total	167,4	167,9	121,8	109,8	38,1	49,6	8,0

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

* 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	17 al 21 de Enero				24 al 28 de Enero				31 de Ene. al 4 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	5	175	1691	1755	7	201	1002	1187	4	135	615	1314
Intragrupa y off-shore***	0	0	1014	704	0	0	700	216	0	0	918	137
Otros	175	5	416	661	201	7	295	593	135	4	243	326
Total	180	180	3121	3121	208	208	1997	1997	138	138	1777	1777

* 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