

Fecha de Publicación: 20 de Enero de 2011
Fecha de Información: 18 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\$1224,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -5,8%.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	177,3	69,0	16,5	93,5	14,5	45,9	38,0
15-35	169,2	340,6	191,4	108,0	119,1	31,2	30,0
36-60	70,4	93,4	35,0	30,0	18,4	0,4	40,0
61-90	40,8	63,4	10,0	19,0	53,4	21,8	0,0
91-180	84,0	87,8	40,0	10,0	17,8	44,0	30,0
>180	12,0	16,6	10,0	0,0	6,6	12,0	0,0
Total	553,7	670,7	302,9	260,5	229,8	155,2	138,0

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

* 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	131	1783	1798	7	201	1052	1235	4	135	662	1324
Intragrupa y off-shore***	0	0	1015	778	0	0	715	231	0	0	918	143
Otros	131	5	440	662	201	7	307	608	135	4	244	357
Total	135	135	3238	3238	209	209	2074	2074	139	139	1824	1824

* 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