

Fecha de Publicación: 24 de Enero de 2011
 Fecha de Información: 20 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\$1276,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -4,6%.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	204,1	138,8	74,0	107,8	6,8	38,4	58,0
15-35	436,3	265,9	163,3	295,0	80,6	119,3	22,0
36-60	0,1	19,2	0,0	0,0	19,2	0,1	0,0
61-90	43,4	11,7	0,0	15,0	11,7	28,4	0,0
91-180	26,6	20,3	0,0	0,0	20,3	26,6	0,0
>180	5,3	104,3	100,0	0,0	4,3	5,3	0,0
Total	715,8	560,3	337,3	417,8	143,0	218,1	80,0

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

* 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	107	1803	1802	7	150	1190	1358	4	139	888	1430
Intragrupa y off-shore***	0	0	1015	793	0	0	745	316	0	0	967	263
Otros	107	5	439	662	150	7	383	643	139	4	246	407
Total	112	112	3257	3257	156	156	2318	2318	143	143	2100	2100

* 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