

Fecha de Publicación: 25 de Enero de 2011
Fecha de Información: 21 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\$976,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -3,2%.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	74,8	62,1	29,2	26,0	1,9	17,8	31,0
15-35	270,7	144,0	78,0	220,6	36,0	20,2	30,0
36-60	18,9	41,2	15,0	0,0	11,2	3,9	15,0
61-90	4,6	17,4	0,0	0,0	14,4	1,6	3,0
91-180	67,2	41,0	0,0	15,0	26,0	37,2	15,0
>180	50,3	184,0	145,0	20,0	19,0	10,3	20,0
Total	486,6	489,7	267,2	281,6	108,5	91,1	114,0

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

* 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	102	1803	1806	7	137	1218	1403	5	133	933	1457
Intragrupa y off-shore***	0	0	1015	793	0	0	774	327	0	0	967	278
Otros	102	5	443	662	137	7	389	650	132	5	252	416
Total	107	107	3261	3261	144	144	2381	2381	138	138	2151	2151

* 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