

Fecha de Publicación: 26 de Enero de 2011
Fecha de Información: 24 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\$968,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -4,3%.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	236,3	100,1	20,0	142,0	15,1	29,3	65,0
15-35	167,1	305,1	155,1	100,0	101,0	18,1	49,0
36-60	21,5	7,7	0,0	8,2	5,7	11,3	2,0
61-90	10,4	4,0	0,0	10,0	4,0	0,4	0,0
91-180	46,6	23,4	0,0	0,0	23,4	46,6	0,0
>180	5,8	40,4	30,0	0,0	10,4	5,8	0,0
Total	487,7	480,7	205,1	260,2	159,6	111,5	116,0

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

* 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	24 al 28 de Enero				31 de Ene. al 4 de Febrero				7 al 11 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	131	1325	1458	5	122	1061	1505	6	159	992	1569
Intragrupa y off-shore***	0	0	794	408	0	0	967	339	0	0	876	366
Otros	131	8	399	652	122	5	258	443	159	6	508	441
Total	139	139	2518	2518	127	127	2287	2287	165	165	2376	2376

* 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