

Fecha de Publicación: 31 de Enero de 2011
Fecha de Información: 27 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\$1091,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,9%.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	121,7	189,7	115,0	42,5	8,7	13,2	66,0
15-35	185,2	362,6	304,0	108,5	16,6	34,7	42,0
36-60	8,1	8,5	0,0	0,0	8,5	8,1	0,0
61-90	40,5	6,9	0,0	5,0	6,9	35,5	0,0
91-180	19,3	16,7	0,0	0,0	16,7	19,3	0,0
>180	45,5	87,0	50,0	5,0	18,6	22,1	18,4
Total	420,3	671,3	469,0	161,0	75,9	132,9	126,4

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

* 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	69	1428	1727	6	120	1444	1980	6	160	1209	19688
Intragrupa y off-shore***	0	0	986	487	0	0	1094	590	0	0	18956	478
Otros	69	8	456	656	120	6	526	495	159	6	521	519
Total	77	77	2871	2871	126	126	3064	3064	166	166	20686	20686

* 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