

Fecha de Publicación: 1 de Febrero de 2011
Fecha de Información: 28 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\$1743,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -2,1%.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	159,4	235,6	175,5	90,5	29,1	37,9	31,0
15-35	333,1	375,0	179,2	192,0	76,8	22,1	119,0
36-60	82,4	44,6	0,0	20,0	4,6	22,4	40,0
61-90	78,7	94,3	70,0	15,0	4,3	43,7	20,0
91-180	17,3	14,7	0,0	0,0	14,7	17,3	0,0
>180	101,5	206,7	111,0	0,0	10,7	16,5	85,0
Total	772,3	971,0	535,7	317,5	140,3	159,8	295,0

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

* 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	68	1428	1798	7	112	1552	2131	6	160	1259	1773
Intragrupa y off-shore***	0	0	1056	487	0	0	1237	664	0	0	989	495
Otros	68	8	457	656	112	7	535	528	160	6	542	522
Total	77	77	2941	2941	120	120	3323	3323	166	166	2789	2789

* 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