

Fecha de Publicación: 2 de Febrero de 2011
Fecha de Información: 31 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\$1309,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,6%.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	461,4	154,1	56,0	369,2	21,1	15,2	77,0
15-35	116,7	280,1	247,0	96,0	14,1	1,7	19,0
36-60	13,3	12,8	5,0	0,0	7,8	13,3	0,0
61-90	11,6	79,3	75,0	0,0	4,3	11,6	0,0
91-180	42,1	11,3	0,0	30,0	11,3	12,1	0,0
>180	48,9	77,4	75,0	0,0	2,4	48,9	0,0
Total	694,0	615,0	458,0	495,2	61,0	102,8	96,0

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

* 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	31 de Ene. al 4 de Febrero				7 al 11 de Febrero				14 al 18 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	78	1937	2260	7	160	1329	1827	15	189	1262	1654
Intragrupa y off-shore***	0	0	1283	1003	0	0	999	525	0	0	917	539
Otros	78	7	580	536	160	7	548	523	189	15	611	596
Total	85	85	3799	3799	167	167	2875	2875	203	203	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