

Fecha de Publicación: 3 de Febrero de 2011
Fecha de Información: 01 de Febrero 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\$1339,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,9%.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	315,0	155,9	36,0	178,0	6,5	23,6	113,4
15-35	296,3	268,4	209,0	219,0	36,4	54,3	23,0
36-60	29,5	4,5	0,0	0,0	4,5	29,5	0,0
61-90	15,7	46,9	25,0	0,0	21,9	15,7	0,0
91-180	3,2	48,8	20,0	0,0	28,8	3,2	0,0
>180	15,3	139,6	115,5	0,0	14,1	5,3	10,0
Total	675,0	664,0	405,5	397,0	112,1	131,6	146,4

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

* 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	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**	11	69	2070	2350	12	159	1485	1907	19	189	1304	1699
Intragrupa y off-shore***	0	0	1319	1096	0	0	999	595	0	0	952	557
Otros	69	11	599	542	159	12	548	530	189	19	611	611
Total	80	80	3988	3988	171	171	3032	3032	208	208	2867	2867

* 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