

Fecha de Publicación: 04 de Febrero de 2011
Fecha de Información: 02 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\$1708,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -2,3%.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	417,7	236,8	38,0	312,0	140,8	47,7	58,0
15-35	358,8	465,7	352,0	85,0	8,7	168,8	105,0
36-60	14,3	0,5	0,0	0,0	0,5	14,3	0,0
61-90	34,4	41,3	0,0	0,0	41,3	34,4	0,0
91-180	11,0	19,6	0,0	0,0	19,6	11,0	0,0
>180	48,2	60,0	20,0	5,0	0,0	3,2	40,0
Total	884,4	823,9	410,0	402,0	210,9	279,4	203,0

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

* 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	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	40	2251	2369	13	159	1662	2132	19	190	1383	1709
Intragrupa y off-shore***	0	0	1319	1277	0	0	1037	689	0	0	952	594
Otros	40	11	619	542	159	13	686	563	190	19	613	644
Total	51	51	4188	4188	172	172	3385	3385	210	210	2947	2947

* 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