

Fecha de Publicación: 08 de Febrero de 2011
 Fecha de Información: 04 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\$970,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -4,3%.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	225,0	130,3	109,8	144,0	10,5	71,0	10,0
15-35	85,1	383,8	153,3	18,0	168,0	4,6	62,5
36-60	2,9	10,5	0,0	0,0	10,5	2,9	0,0
61-90	35,4	23,9	20,0	20,0	3,9	15,4	0,0
91-180	56,3	5,0	0,0	0,0	5,0	56,3	0,0
>180	4,6	7,8	0,0	0,0	7,8	4,6	0,0
Total	409,5	561,2	283,0	182,0	205,7	155,0	72,5

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

* 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	32	2261	2148	17	141	1993	2610	24	190	1460	1787
Intragrupa y off-shore***	0	0	1339	1277	0	1	1197	883	0	0	1015	624
Otros	32	11	368	542	141	16	958	655	190	24	613	676
Total	44	44	3967	3967	158	158	4148	4148	214	214	3087	3087

* 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