

Fecha de Publicación: 11 de Febrero de 2011
Fecha de Información: 09 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\$1366,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -4,1%.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	274,7	196,0	123,0	111,0	26,8	117,5	46,2
15-35	274,3	405,2	235,5	161,3	118,7	62,1	51,0
36-60	14,3	11,3	0,0	11,0	11,3	3,3	0,0
61-90	17,8	42,1	14,0	0,0	28,1	17,8	0,0
91-180	20,0	42,7	0,0	10,0	42,7	10,0	0,0
>180	20,5	47,6	40,0	0,0	5,6	18,5	2,0
Total	621,6	744,8	412,5	293,3	233,1	229,2	99,2

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

* 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	7 al 11 de Febrero				14 al 18 de Febrero				21 al 25 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	60	2397	2895	28	192	1659	1975	7	145	2076	2161
Intragrupa y off-shore***	0	1	1311	1084	7	0	1069	742	0	0	1396	1092
Otros	60	14	1039	767	185	28	700	711	145	7	326	545
Total	76	76	4747	4747	220	220	3427	3427	152	152	3798	3798

* 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