

Fecha de Publicación: 25 de Febrero de 2011
 Fecha de Información: 23 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\$1376,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -4,9%.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	342,6	148,8	72,0	239,1	29,8	56,4	47,0
15-35	341,0	393,3	298,7	162,0	24,6	109,0	70,0
36-60	10,3	0,7	0,0	0,0	0,7	10,3	0,0
61-90	43,0	45,8	35,0	0,0	10,8	43,0	0,0
91-180	1,8	2,8	0,0	0,0	2,8	1,8	0,0
>180	6,8	40,0	35,0	0,0	5,0	6,8	0,0
Total	745,4	631,4	440,7	401,1	73,6	227,3	117,0

* 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	-2,2 %	-2,5 %	-11,8 %	-8,2 %
15-35	-2,2 %	-3,9 %	-3,7 %	-3,6 %
36-60	-	-1,4 %	-3,4 %	-3,3 %
61-90	-	-1,4 %	-3,1 %	-2,2 %
91-180	-	0,3 %	-2,0 %	-0,6 %
>180	-	0,4 %	0,1 %	0,4 %
Total	-2,2 %	-2,9 %	-7,0 %	-4,9 %

* 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	21 al 25 de Febrero				28 de Feb. al 4 de Marzo				7 al 11 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	105	2684	2756	9	88	1909	2389	8	193	1586	1584
Intragrupa y off-shore***	0	0	1786	1346	0	0	1487	885	0	0	668	555
Otros	105	37	401	769	88	9	435	556	193	8	444	558
Total	142	142	4871	4871	97	97	3831	3831	201	201	2698	2698

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo