

Fecha de Publicación: 16 de Febrero de 2011
Fecha de Información: 14 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\$737,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -3,6%.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	132,0	80,4	34,0	43,2	18,4	60,8	28,0
15-35	162,0	137,7	89,0	113,0	34,7	35,0	14,0
36-60	11,9	39,4	0,0	0,0	29,4	1,9	10,0
61-90	21,5	69,9	20,0	0,0	49,9	21,5	0,0
91-180	0,2	29,2	0,0	0,0	29,2	0,2	0,0
>180	15,0	38,3	35,0	0,0	3,3	15,0	0,0
Total	342,5	394,8	178,0	156,2	164,8	134,3	52,0

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

* 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	14 al 18 de Febrero				21 al 25 de Febrero				28 de Feb. al 4 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	160	1991	2151	9	145	2150	2322	6	87	1463	1955
Intragrupa y off-shore***	7	0	1173	909	0	0	1521	1098	0	0	1275	659
Otros	152	29	714	818	145	9	344	594	87	6	345	469
Total	189	189	3877	3877	154	154	4015	4015	93	93	3083	3083

* 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