

Fecha de Publicación: 22 de Febrero de 2011
 Fecha de Información: 18 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\$666,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -2,6%.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	62,1	116,3	96,0	44,0	5,3	3,1	15,0
15-35	225,3	70,6	33,5	188,0	19,1	19,3	18,0
36-60	1,2	17,9	0,0	0,0	17,9	1,2	0,0
61-90	18,5	11,2	0,0	0,0	11,2	18,5	0,0
91-180	6,9	38,2	0,0	0,0	38,2	6,9	0,0
>180	23,1	74,8	72,0	0,0	2,8	23,1	0,0
Total	337,1	329,1	201,5	232,0	94,6	72,1	33,0

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

* 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**	27	79	2243	2292	18	128	2392	2648	8	87	1638	2243
Intragrupa y off-shore***	7	0	1245	1022	0	0	1738	1171	0	0	1420	708
Otros	72	27	765	939	128	18	368	678	87	8	396	503
Total	106	106	4254	4254	146	146	4498	4498	94	94	3454	3454

* 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