

Fecha de Publicación: 23 de Febrero de 2011
Fecha de Información: 21 de Febrero de 2011¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$131,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -3,2%.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	6,4	2,3	0,0	0,0	2,3	6,4	0,0
15-35	41,5	33,8	7,0	20,0	26,8	21,5	0,0
36-60	3,4	15,0	0,0	0,0	15,0	3,4	0,0
61-90	15,3	3,2	0,0	0,0	3,2	15,3	0,0
91-180	0,7	4,8	0,0	0,0	4,8	0,7	0,0
>180	0,1	5,0	0,0	0,0	5,0	0,1	0,0
Total	67,4	64,0	7,0	20,0	57,0	47,4	0,0

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

*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	116	2393	2661	8	87	1643	2243	7	193	1521	1455
Intragrupa y off-shore***	0	0	1738	1171	0	0	1420	708	0	0	594	555
Otros	116	37	381	679	87	8	396	508	193	7	444	549
Total	153	153	4512	4512	94	94	3459	3459	200	200	2559	2559

* 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