

Fecha de Publicación: 24 de Febrero de 2011
 Fecha de Información: 22 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\$919,0 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	231,1	176,6	107,0	113,0	19,6	68,1	50,0
15-35	166,3	148,0	69,7	105,0	54,3	37,3	24,0
36-60	2,8	2,8	0,0	0,0	2,8	2,8	0,0
61-90	80,4	40,3	10,0	0,0	10,3	60,4	20,0
91-180	10,7	15,0	0,0	0,0	15,0	10,7	0,0
>180	6,2	38,8	35,0	0,0	3,8	6,2	0,0
Total	497,6	421,4	221,7	218,0	105,7	185,6	94,0

* 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	-2,8 %	-2,4 %	-2,6 %	-2,6 %
15-35	-4,1 %	-3,4 %	-3,5 %	-3,5 %
36-60	-	0,9 %	-1,3 %	-0,2 %
61-90	-1,1 %	-1,3 %	-3,1 %	-2,3 %
91-180	-	-0,9 %	-0,9 %	-0,9 %
>180	-	1,5 %	-0,2 %	1,2 %
Total	-2,7 %	-2,0 %	-2,9 %	-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	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	113	2474	2726	8	87	1773	2281	7	193	1543	1542
Intragrupa y off-shore***	0	0	1781	1194	0	0	1427	798	0	0	661	555
Otros	113	37	393	728	87	8	406	528	193	7	444	550
Total	150	150	4648	4648	95	95	3606	3606	200	200	2648	2648

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo