

Fecha de Publicación: 28 de Febrero de 2011
Fecha de Información: 24 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\$1337,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -3,3%.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	350,2	160,2	56,0	170,0	7,2	83,2	97,0
15-35	259,2	343,1	219,0	40,0	47,1	142,2	77,0
36-60	3,3	31,7	0,0	0,0	31,7	3,3	0,0
61-90	16,5	9,5	0,0	0,0	9,5	16,5	0,0
91-180	21,0	57,6	0,0	0,2	37,6	0,8	20,0
>180	28,6	56,1	0,0	0,2	44,4	16,7	11,8
Total	678,8	658,2	275,0	210,3	177,4	262,7	205,8

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

* 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**	36	53	2751	2837	9	83	2162	2499	8	193	1612	1604
Intragrupa y off-shore***	0	0	1794	1385	0	0	1535	1015	0	0	668	556
Otros	53	36	452	774	83	9	442	625	193	8	445	564
Total	89	89	4997	4997	92	92	4139	4139	201	201	2725	2725

* 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