

Fecha de Publicación: 03 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 01 de Marzo 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\$849,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -5,2%.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	156,0	111,0	47,5	71,9	30,5	51,1	33,0
15-35	165,7	304,9	140,5	33,0	110,4	78,7	54,0
36-60	14,5	4,4	0,0	10,0	4,4	4,5	0,0
61-90	18,3	1,4	0,0	0,0	1,4	18,3	0,0
91-180	3,6	26,3	10,0	0,0	16,3	3,6	0,0
>180	31,0	12,5	0,0	5,0	12,5	26,0	0,0
Total	389,0	460,6	198,0	119,9	175,6	182,1	87,0

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

* 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	28 de Feb. al 4 de Marzo				7 al 11 de Marzo				14 al 18 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	61	2448	2739	11	197	1748	1698	22	259	1703	1909
Intragrupa y off-shore***	0	0	1702	1219	0	0	714	634	0	0	1001	873
Otros	60	13	462	655	197	11	477	606	259	22	549	470
Total	74	74	4612	4612	208	208	2938	2938	281	281	3252	3252

* 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