

Fecha de Publicación: 04 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 02 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\$656,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -5,0%.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	107,1	180,0	110,0	52,5	31,0	15,6	39,0
15-35	136,8	137,8	71,3	30,5	18,5	58,3	48,0
36-60	2,4	7,3	0,0	0,0	7,3	2,4	0,0
61-90	30,7	14,4	0,0	0,0	14,4	30,7	0,0
91-180	5,0	4,4	0,0	0,0	4,4	5,0	0,0
>180	27,6	2,6	2,5	5,0	0,1	22,6	0,0
Total	309,6	346,6	183,8	88,0	75,8	134,6	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	-4,2 %	-3,7 %	-10,3 %	-6,5 %
15-35	-4,6 %	-5,3 %	-6,0 %	-5,4 %
36-60	-	-3,9 %	-5,6 %	-4,3 %
61-90	-4,0 %	-0,8 %	-3,6 %	-2,7 %
91-180	-2,5 %	0,0 %	-2,7 %	-1,4 %
>180	-	1,2 %	-0,5 %	-0,4 %
Total	-4,4 %	-4,2 %	-5,9 %	-5,0 %

* 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**	12	55	2488	2751	11	182	1813	1870	22	260	1705	1909
Intragrupa y off-shore***	0	0	1712	1252	0	0	814	654	0	0	1001	873
Otros	55	12	462	660	182	11	512	615	260	22	549	473
Total	67	67	4662	4662	193	193	3139	3139	282	282	3255	3255

* 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