

Fecha de Publicación: 08 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 04 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\$1189,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -4,7%.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	206,8	287,7	221,8	65,0	25,9	101,8	40,0
15-35	111,5	247,1	181,7	89,0	43,4	0,5	22,0
36-60	6,0	52,2	0,0	0,0	52,2	6,0	0,0
61-90	69,7	79,1	0,0	25,0	79,1	44,7	0,0
91-180	25,9	42,4	25,0	0,0	17,4	25,9	0,0
>180	31,1	29,9	27,0	8,0	0,9	21,1	2,0
Total	451,0	738,5	455,5	187,0	219,0	200,0	64,0

* 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	-1,5 %	-4,0 %	-10,5 %	-7,5 %
15-35	-2,3 %	-4,5 %	-4,4 %	-4,3 %
36-60	-	-3,7 %	-4,8 %	-3,8 %
61-90	-	-3,9 %	-3,1 %	-3,5 %
91-180	-	-1,8 %	-3,0 %	-2,2 %
>180	-0,5 %	-0,1 %	-0,9 %	-0,5 %
Total	-1,7 %	-3,8 %	-6,5 %	-4,7 %

* 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	46	2515	2787	11	167	2107	2119	24	260	1731	2072
Intragrupa y off-shore***	0	0	1716	1269	0	0	977	739	0	0	1164	874
Otros	46	12	485	660	167	11	552	778	260	24	549	497
Total	58	58	4716	4716	178	178	3636	3636	284	284	3444	3444

* 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