

Fecha de Publicación: 23 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 18 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\$1151,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,9%.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	169,1	263,8	125,0	58,0	33,8	6,1	105,0
15-35	232,1	187,4	61,8	130,3	30,7	6,9	95,0
36-60	105,4	42,5	0,0	35,0	7,5	35,4	35,0
61-90	15,9	24,9	0,0	0,0	24,9	15,9	0,0
91-180	23,9	53,1	5,0	15,0	43,1	3,9	5,0
>180	26,3	6,9	0,0	20,0	6,9	6,3	0,0
Total	572,7	578,6	191,8	258,3	146,8	74,5	240,0

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

* 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	14 al 18 de Marzo				21 al 25 de Marzo				28 de Mar. al 1 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	138	2669	3032	12	156	1321	1725	8	471	1579	1751
Intragrupa y off-shore***	5	1	1890	1344	0	0	1027	464	0	0	784	499
Otros	132	33	599	782	156	12	361	519	471	8	493	606
Total	172	172	5158	5158	168	168	2708	2708	479	479	2855	2855

* 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