

Fecha de Publicación: 24 de Marzo de 2011
 Fecha de Información: 22 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\$1175,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	94,2	323,1	169,0	6,0	105,1	39,2	49,0
15-35	244,7	324,3	87,0	112,5	189,3	84,2	48,0
36-60	23,0	12,3	0,0	10,0	12,3	13,0	0,0
61-90	47,1	9,9	0,0	0,0	9,9	47,1	0,0
91-180	19,5	6,8	0,0	15,0	6,8	4,5	0,0
>180	14,2	56,9	15,0	5,0	39,9	7,2	2,0
Total	442,7	733,2	271,0	148,5	363,2	195,2	99,0

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

*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

Sectores	21 al 25 de Marzo				28 de Mar. al 1 de Abril				4 al 8 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	110	1323	1904	8	550	1671	1847	9	162	1677	1620
Intragruppo y off-shore***	0	0	1174	464	0	0	818	553	0	0	725	726
Otros	110	12	393	521	550	8	506	595	162	9	551	607
Total	122	122	2889	2889	558	558	2995	2995	171	171	2952	2952

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo