

Fecha de Publicación: 25 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 23 de Marzo de 2011¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1247,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,0%.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	65,7	287,7	190,0	24,7	67,7	11,0	30,0
15-35	212,4	322,2	212,5	78,0	38,0	62,7	71,7
36-60	24,7	0,6	0,6	0,0	0,0	24,7	0,0
61-90	74,8	30,6	0,0	12,0	15,6	47,8	15,0
91-180	162,8	35,3	7,0	135,0	13,3	12,8	15,0
>180	25,0	5,9	5,0	7,0	0,9	18,0	0,0
Total	565,5	682,2	415,1	256,7	135,4	177,1	131,7

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,0 %	0,3 %	-0,8 %	0,1 %
15-35	0,1 %	0,1 %	0,0 %	0,1 %
36-60	-	0,0 %	-0,3 %	-0,3 %
61-90	-0,2 %	0,2 %	-0,3 %	-0,2 %
91-180	0,0 %	0,6 %	-0,4 %	-0,2 %
>180	-	1,0 %	0,2 %	0,4 %
Total	0,0 %	0,2 %	-0,2 %	0,0 %

*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	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	105	1335	1925	9	617	1723	1953	9	162	1677	1716
Intragruppo y off-shore***	0	0	1189	471	0	0	898	571	0	0	820	726
Otros	105	12	395	523	617	9	506	603	162	9	552	607
Total	117	117	2919	2919	626	626	3127	3127	171	171	3049	3049

* 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 intragruppo