

Fecha de Publicación: 28 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 24 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\$1386,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.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	237,3	196,8	132,3	155,1	2,1	19,6	62,5
15-35	338,1	376,0	173,6	157,0	99,0	77,6	103,5
36-60	48,0	16,1	0,1	1,8	16,1	46,2	0,0
61-90	14,9	6,9	0,1	0,0	6,9	14,9	0,0
91-180	61,4	41,0	5,0	0,0	16,0	41,4	20,0
>180	4,2	45,9	43,0	0,0	2,9	4,2	0,0
Total	703,8	682,8	353,9	313,9	142,9	203,9	186,0

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

* 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	107	1384	1953	9	617	1787	2081	9	162	1810	1763
Intragrupa y off-shore***	0	0	1221	520	0	0	992	586	0	0	826	817
Otros	107	12	391	522	617	9	510	622	162	9	552	608
Total	120	120	2995	2995	626	626	3289	3289	171	171	3188	3188

* 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