

Fecha de Publicación: 29 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 25 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\$976,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,6%.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	223,7	195,0	103,0	121,0	22,0	32,7	70,0
15-35	138,7	236,4	154,0	79,0	47,4	24,7	35,0
36-60	65,4	0,4	0,0	14,0	0,4	51,4	0,0
61-90	5,6	16,9	0,0	0,0	16,9	5,6	0,0
91-180	36,7	32,5	10,0	0,0	22,5	36,7	0,0
>180	3,2	21,6	5,0	0,0	16,6	3,2	0,0
Total	473,2	503,0	272,0	214,0	126,0	154,2	105,0

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

* 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	95	1384	1954	9	531	1980	2216	9	162	1841	1884
Intragrupa y off-shore***	0	0	1221	520	0	0	995	699	0	0	926	825
Otros	95	12	391	522	531	9	572	631	162	9	573	632
Total	107	107	2996	2996	540	540	3547	3547	172	172	3341	3341

* 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