

Fecha de Publicación: 31 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 29 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\$1550,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -2,9%.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	325,0	170,9	138,5	242,2	7,4	57,8	25,0
15-35	250,0	506,5	296,5	117,0	88,5	11,5	121,5
36-60	41,0	56,6	5,0	0,0	51,6	41,0	0,0
61-90	10,7	9,4	0,0	0,0	9,4	10,7	0,0
91-180	60,4	62,3	40,0	0,0	22,3	60,4	0,0
>180	22,6	34,6	0,0	15,0	34,6	7,6	0,0
Total	709,7	840,4	480,0	374,2	213,9	189,0	146,5

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

* 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	28 de Mar. al 1 de Abril				4 al 8 de Abril				11 al 15 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	501	2359	2345	10	175	2035	2080	18	133	1820	1741
Intragrupa y off-shore***	0	0	1112	1052	0	0	1074	879	0	0	634	542
Otros	501	7	579	653	175	10	581	731	133	18	722	889
Total	508	508	4050	4050	184	184	3690	3690	151	151	3175	3172

* 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