

Fecha de Publicación: 10 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 08 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\$1734,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -4,4%.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	291,5	326,3	252,0	153,2	16,4	80,3	58,0
15-35	371,7	482,6	202,3	87,0	79,3	83,7	201,0
36-60	5,7	77,4	0,2	0,0	77,2	5,7	0,0
61-90	4,6	15,6	0,0	0,0	15,6	4,6	0,0
91-180	67,2	64,7	10,0	40,0	48,7	21,2	6,0
>180	13,0	14,2	5,0	0,0	9,2	13,0	0,0
Total	753,7	980,8	469,4	280,2	246,4	208,5	265,0

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

* 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	7 al 11 de Marzo				14 al 18 de Marzo				21 al 25 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	150	2247	2222	31	266	2044	2420	11	157	1013	1190
Intragrupa y off-shore***	0	0	1002	769	5	0	1405	1018	0	0	673	336
Otros	150	11	570	828	261	31	551	563	157	11	267	426
Total	161	161	3819	3819	297	297	4000	4000	168	168	1953	1953

* 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