

Fecha de Publicación: 11 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 09 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\$1803,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -3,0%.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	264,4	329,4	240,1	109,6	26,3	91,8	63,0
15-35	376,4	398,6	121,5	234,5	197,1	61,9	80,0
36-60	0,6	25,7	10,0	0,0	15,7	0,6	0,0
61-90	34,1	52,2	1,0	0,0	51,2	34,1	0,0
91-180	73,4	74,4	20,0	45,0	46,4	20,4	8,0
>180	91,5	82,7	68,9	8,0	3,8	73,5	10,0
Total	840,5	963,0	461,5	397,1	340,5	282,3	161,0

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

* 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	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	136	2262	2349	32	261	2277	2619	11	158	1042	1221
Intragrupa y off-shore***	0	0	1097	769	5	1	1530	1117	0	0	694	355
Otros	136	11	583	824	255	31	582	652	158	11	270	430
Total	147	147	3942	3942	292	292	4389	4389	169	169	2005	2005

* 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