

Fecha de Publicación: 14 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 10 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\$932,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -2,5%.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	151,3	46,8	37,8	77,5	9,0	73,8	0,0
15-35	217,3	176,8	56,0	126,3	85,8	56,0	35,0
36-60	0,0	15,1	0,0	0,0	15,1	0,0	0,0
61-90	0,0	61,6	20,0	0,0	41,6	0,0	0,0
91-180	75,0	89,3	35,0	5,0	44,3	60,0	10,0
>180	41,4	58,0	5,0	20,0	53,0	21,4	0,0
Total	484,9	447,5	153,8	228,8	248,7	211,1	45,0

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

* 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**	10	131	2270	2377	33	262	2414	2642	11	158	1048	1230
Intragrupa y off-shore***	0	0	1120	778	5	1	1545	1186	0	0	694	355
Otros	131	10	587	823	257	32	589	720	158	11	280	436
Total	141	141	3977	3977	295	295	4548	4548	169	169	2021	2021

* 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