

Fecha de Publicación: 15 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 11 de Marzo de 2011¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1045,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -3,4%.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	112,4	181,3	92,0	77,0	69,3	15,4	20,0
15-35	254,3	203,1	105,9	189,1	50,1	18,2	47,0
36-60	14,3	29,9	0,0	0,0	29,9	14,3	0,0
61-90	28,0	49,1	0,0	5,0	49,1	23,0	0,0
91-180	50,7	41,9	0,7	0,0	41,3	50,7	0,0
>180	15,8	64,5	33,9	0,0	30,6	15,8	0,0
Total	475,5	569,8	232,5	271,1	270,3	137,4	67,0

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

* 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**	10	128	2270	2377	33	255	2526	2747	12	164	1048	1307
Intragrupa y off-shore***	0	0	1120	778	5	1	1575	1263	0	0	756	355
Otros	128	10	588	822	250	32	644	735	164	12	295	436
Total	138	138	3977	3977	289	289	4745	4745	176	176	2098	2098

* 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