

Fecha de Publicación: 16 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 14 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\$1018,2 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	93,2	135,6	123,0	51,0	2,6	32,2	10,0
15-35	244,5	238,7	123,5	93,6	48,2	83,9	67,0
36-60	24,8	51,3	0,0	10,0	39,3	2,8	12,0
61-90	0,1	10,2	0,0	0,0	10,2	0,1	0,0
91-180	59,8	53,4	0,0	0,0	53,4	59,8	0,0
>180	29,3	77,3	0,0	0,0	67,3	19,3	10,0
Total	451,8	566,4	246,5	154,6	220,9	198,2	99,0

* 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	-0,2 %	-2,5 %	-4,2 %	-3,4 %
15-35	-3,1 %	-3,0 %	-4,0 %	-3,5 %
36-60	-3,3 %	-2,9 %	-3,5 %	-3,1 %
61-90	-	-1,3 %	-4,1 %	-1,3 %
91-180	-	-2,1 %	-2,4 %	-2,2 %
>180	0,1 %	-1,0 %	-0,9 %	-0,8 %
Total	-2,5 %	-2,3 %	-3,6 %	-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	14 al 18 de Marzo				21 al 25 de Marzo				28 de Mar. al 1 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	216	2592	2833	12	164	1069	1318	6	318	1321	1472
Intragrupa y off-shore***	5	1	1695	1306	0	0	756	363	0	0	679	405
Otros	211	34	610	758	164	12	295	440	318	6	454	576
Total	252	252	4897	4897	175	175	2120	2120	324	324	2454	2454

* 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