

Fecha de Publicación: 17 de Marzo de 2011
Fecha de Información: 15 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\$1083,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -3,6%.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	55,0	229,4	200,6	25,0	24,8	26,0	4,0
15-35	253,5	260,3	78,5	59,3	96,2	108,6	85,6
36-60	57,0	31,7	0,0	5,0	26,7	47,0	5,0
61-90	45,0	26,3	0,0	0,0	26,3	45,0	0,0
91-180	20,7	33,6	20,0	0,0	3,6	10,7	10,0
>180	41,2	29,5	4,0	0,0	25,5	41,2	0,0
Total	472,4	610,7	303,1	89,3	203,0	278,5	104,6

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

* 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**	37	200	2620	2932	12	163	1076	1429	6	348	1345	1474
Intragrupa y off-shore***	5	1	1785	1326	0	0	866	368	0	0	679	410
Otros	194	35	615	762	163	12	297	441	347	6	456	596
Total	236	236	5021	5021	175	175	2238	2238	354	354	2480	2480

* 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