

Fecha de Publicación: 05 de Abril de 2011
Fecha de Información: 01 de Abril 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\$1456,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,9%.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	125,7	182,6	98,0	83,0	59,6	17,7	25,0
15-35	418,1	260,9	102,0	355,0	107,9	12,1	51,0
36-60	17,3	65,3	0,0	0,0	53,3	5,3	12,0
61-90	58,7	153,5	45,7	25,0	102,9	28,7	5,0
91-180	13,3	75,9	0,0	0,0	75,9	13,3	0,0
>180	33,5	51,5	30,0	25,0	14,5	1,5	7,0
Total	666,6	789,7	275,7	488,0	414,0	78,6	100,0

* 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	4,4 %	-1,7 %	3,8 %	1,2 %
15-35	-1,8 %	-0,6 %	-2,4 %	-1,8 %
36-60	-1,7 %	-2,1 %	-5,5 %	-2,3 %
61-90	14,2 %	-0,8 %	-1,8 %	-0,7 %
91-180	-	-0,4 %	-2,2 %	-0,7 %
>180	0,3 %	-0,6 %	-0,3 %	-0,4 %
Total	0,5 %	-0,9 %	-1,2 %	-0,9 %

* 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	28 de Mar. al 1 de Abril				4 al 8 de Abril				11 al 15 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	486	2451	2444	14	155	2302	2458	26	139	1983	1936
Intragrupa y off-shore***	0	0	1200	1127	0	0	1338	1019	0	0	716	617
Otros	486	8	580	659	155	14	606	770	139	26	799	942
Total	494	494	4231	4231	169	169	4247	4247	164	164	3497	3494

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo