

Fecha de Publicación: 06 de Abril de 2011
Fecha de Información: 04 de Abril 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\$1207,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,4%.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	144,6	269,8	155,7	51,0	48,1	27,6	66,0
15-35	136,8	260,9	119,3	59,0	115,6	51,8	26,0
36-60	93,4	82,0	0,0	40,0	82,0	53,4	0,0
61-90	16,2	12,2	0,0	15,0	12,2	1,2	0,0
91-180	26,0	39,7	0,0	0,0	39,7	26,0	0,0
>180	54,4	71,6	0,0	19,0	51,6	15,4	20,0
Total	471,3	736,2	275,0	184,0	349,2	175,3	112,0

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

* 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	4 al 8 de Abril				11 al 15 de Abril				18 al 22 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	155	2412	2549	26	140	2018	2067	5	96	993	1219
Intragrupa y off-shore***	0	0	1371	1070	0	0	821	617	0	0	677	438
Otros	155	14	607	773	140	26	815	967	96	5	294	307
Total	168	168	4391	4391	165	165	3655	3652	100	100	1964	1964

* 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