

Fecha de Publicación: 07 de Abril de 2011
Fecha de Información: 05 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\$1472,4 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	214,9	235,6	144,5	134,8	15,1	4,1	76,0
15-35	255,2	345,6	91,6	102,0	104,0	3,2	150,0
36-60	183,7	26,5	0,0	32,0	26,5	151,7	0,0
61-90	2,6	21,1	0,0	0,0	21,1	2,6	0,0
91-180	93,6	44,8	0,0	0,0	44,8	93,6	0,0
>180	26,6	22,1	0,0	5,0	12,1	11,6	10,0
Total	776,6	695,8	236,1	273,8	223,7	266,9	236,0

* 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	-0,4 %	-0,7 %	-2,7 %	-1,5 %
15-35	-0,9 %	-1,6 %	-1,9 %	-1,4 %
36-60	-	-0,6 %	-2,4 %	-2,2 %
61-90	-	-0,4 %	-1,9 %	-0,6 %
91-180	-	0,7 %	-1,5 %	-0,8 %
>180	0,0 %	0,3 %	-0,2 %	0,0 %
Total	-0,7 %	-0,9 %	-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	149	2529	2602	26	141	2082	2191	5	98	1035	1273
Intragrupa y off-shore***	0	0	1416	1169	0	0	920	657	0	0	678	433
Otros	149	14	606	780	141	26	821	971	98	5	301	307
Total	163	163	4551	4551	167	167	3822	3819	103	103	2014	2014

* 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