

Fecha de Publicación: 08 de Abril de 2011
 Fecha de Información: 06 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\$1209,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,1%.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	129,4	244,2	202,7	80,9	7,6	14,5	34,0
15-35	288,8	219,0	106,0	129,3	48,0	94,6	65,0
36-60	40,4	70,3	30,0	36,0	40,3	4,4	0,0
61-90	29,8	82,6	0,0	0,0	67,6	14,8	15,0
91-180	0,0	32,9	10,0	0,0	22,9	0,0	0,0
>180	27,9	44,0	20,0	10,0	24,0	17,9	0,0
Total	516,4	693,1	368,7	256,2	210,4	146,3	114,0

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

* 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	136	2594	2666	28	144	2137	2385	5	108	1061	1274
Intragrupa y off-shore***	0	0	1461	1215	0	0	1097	687	0	0	678	458
Otros	136	14	605	779	144	28	823	982	108	5	302	309
Total	149	149	4660	4660	172	172	4057	4054	113	113	2041	2041

* 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