

Fecha de Publicación: 11 de Abril de 2011
Fecha de Información: 07 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\$1382,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,3%.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	207,8	227,8	73,2	51,7	4,6	6,1	150,0
15-35	372,2	248,1	70,0	201,5	76,1	68,7	102,0
36-60	75,5	13,2	0,0	0,0	13,2	75,5	0,0
61-90	0,8	53,7	0,0	0,0	53,7	0,8	0,0
91-180	54,1	69,1	0,0	0,0	34,1	19,1	35,1
>180	14,6	45,4	20,0	10,0	25,4	4,6	0,0
Total	725,0	657,2	163,2	263,2	206,9	174,7	287,1

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

* 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**	16	136	2626	2676	26	144	2321	2612	5	105	1064	1276
Intragrupa y off-shore***	0	0	1471	1242	0	0	1170	720	0	0	678	460
Otros	136	16	605	784	144	26	827	984	105	5	304	310
Total	152	152	4702	4702	170	170	4318	4315	110	110	2046	2046

* 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