

Fecha de Publicación: 12 de Abril de 2011
Fecha de Información: 08 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\$987,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,0%.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	161,4	146,6	128,0	97,6	7,6	52,8	11,0
15-35	207,7	226,4	81,0	151,0	106,4	17,7	39,0
36-60	15,1	34,8	0,0	4,0	24,8	1,1	10,0
61-90	41,8	30,1	0,0	26,0	30,1	15,8	0,0
91-180	27,1	50,2	0,7	10,0	44,4	12,1	5,0
>180	30,2	16,2	10,0	15,0	6,2	15,2	0,0
Total	483,3	504,2	219,7	303,6	219,5	114,7	65,0

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

* 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**	13	126	2629	2678	31	143	2464	2758	7	106	1076	1276
Intragrupa y off-shore***	0	0	1471	1242	0	0	1298	806	0	1	678	470
Otros	126	13	607	787	143	31	834	1029	106	6	304	312
Total	140	140	4708	4708	174	174	4596	4593	113	113	2058	2058

* 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