

Fecha de Publicación: 13 de Abril de 2011
Fecha de Información: 11 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\$1240,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,0%.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	109,2	148,8	99,0	24,0	19,8	55,2	30,0
15-35	267,1	301,1	89,0	154,0	163,1	64,1	49,0
36-60	28,5	45,0	0,0	0,0	45,0	28,5	0,0
61-90	36,3	16,0	0,0	0,0	16,0	36,3	0,0
91-180	151,4	54,7	33,2	57,5	21,5	93,9	0,0
>180	17,3	64,7	0,3	5,0	64,4	12,3	0,0
Total	609,7	630,3	221,5	240,5	329,8	290,2	79,0

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

* 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	11 al 15 de Abril				18 al 22 de Abril				25 al 29 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	145	2534	2842	7	106	1125	1370	13	416	2240	2256
Intragrupa y off-shore***	0	0	1356	823	0	1	751	477	0	0	1205	796
Otros	145	31	850	1072	106	6	305	333	416	13	552	944
Total	175	175	4740	4737	113	113	2181	2181	428	428	3996	3996

* 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