

Fecha de Publicación: 14 de Abril de 2011
Fecha de Información: 12 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\$1013,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,2%.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	164,3	260,0	153,9	15,5	22,1	64,8	84,0
15-35	147,1	210,7	109,0	87,5	78,7	36,6	23,0
36-60	63,0	34,0	10,0	30,0	24,0	33,0	0,0
61-90	29,5	9,7	0,0	0,0	9,7	29,5	0,0
91-180	29,0	42,6	0,0	25,0	42,6	4,0	0,0
>180	8,9	14,3	5,0	5,0	9,3	3,9	0,0
Total	441,8	571,2	277,9	163,0	186,4	171,8	107,0

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

* 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	144	2599	2930	7	105	1206	1503	14	415	2268	2313
Intragrupa y off-shore***	0	0	1420	835	0	1	841	481	0	0	1205	796
Otros	144	31	854	1105	105	6	306	369	415	14	587	951
Total	175	175	4874	4871	112	112	2353	2353	429	429	4060	4060

* 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