

Fecha de Publicación: 15 de Abril de 2011
 Fecha de Información: 13 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\$1276,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	169,1	197,1	112,0	65,0	20,1	39,1	65,0
15-35	237,8	322,5	83,0	55,0	101,2	44,6	138,3
36-60	24,2	20,5	0,0	0,0	20,5	24,2	0,0
61-90	88,4	31,3	0,0	0,0	11,3	68,4	20,0
91-180	42,4	43,7	15,0	0,0	13,7	27,4	15,0
>180	23,3	76,1	10,3	0,0	55,8	13,3	10,0
Total	585,2	691,2	220,3	120,0	222,6	217,0	248,3

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-0,5 %	0,0 %	-4,2 %	-2,2 %
15-35	0,0 %	-0,8 %	0,2 %	-0,3 %
36-60	-	-0,4 %	-1,9 %	-1,2 %
61-90	-0,6 %	1,0 %	-1,0 %	-0,7 %
91-180	-0,7 %	-0,5 %	-1,1 %	-0,8 %
>180	0,4 %	0,5 %	0,8 %	0,5 %
Total	-0,2 %	-0,3 %	-1,6 %	-0,8 %

*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

Sectores	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	133	2659	2938	8	104	1258	1625	14	415	2339	2421
Intragruppo y off-shore***	0	0	1428	875	0	1	941	506	0	0	1244	796
Otros	133	31	854	1125	104	7	308	376	415	14	611	977
Total	164	164	4940	4937	112	112	2507	2507	429	429	4193	4193

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo