

Fecha de Publicación: 16 de Abril de 2011
 Fecha de Información: 14 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\$1051,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,4%.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	51,5	152,6	115,0	15,0	32,6	31,5	5,0
15-35	235,5	272,3	119,0	86,0	62,3	58,5	91,0
36-60	25,1	44,6	0,0	3,9	44,6	21,3	0,0
61-90	10,0	27,8	0,0	10,0	27,8	0,0	0,0
91-180	45,0	66,7	0,0	15,0	36,7	0,0	30,0
>180	69,2	51,6	20,0	10,0	31,6	59,2	0,0
Total	436,3	615,6	254,0	139,9	235,6	170,4	126,0

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

*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	121	2664	2946	8	105	1272	1642	14	427	2371	2535
Intragrupa y off-shore***	0	0	1436	880	0	1	954	506	0	0	1338	806
Otros	121	31	854	1125	105	7	307	385	427	14	631	999
Total	152	152	4954	4951	113	113	2533	2533	441	441	4340	4340

* 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