

Fecha de Publicación: 19 de Abril de 2011
 Fecha de Información: 15 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\$875,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.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	92,1	215,1	133,0	59,0	57,1	8,1	25,0
15-35	148,7	124,4	53,0	106,0	48,9	20,2	22,5
36-60	20,5	94,3	0,0	0,0	94,3	20,5	0,0
61-90	42,0	12,2	3,0	0,0	9,2	42,0	0,0
91-180	24,2	75,1	0,0	0,0	75,1	24,2	0,0
>180	3,5	23,4	0,0	0,0	23,4	3,5	0,0
Total	331,1	544,6	189,0	165,0	308,1	118,6	47,5

* 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 %	1,1 %	0,0 %	0,6 %
15-35	7,6 %	1,0 %	0,4 %	1,3 %
36-60	-	0,5 %	-0,6 %	0,3 %
61-90	-	1,2 %	0,2 %	0,4 %
91-180	-	0,9 %	0,4 %	0,8 %
>180	-	1,0 %	-0,1 %	0,9 %
Total	3,6 %	0,9 %	0,2 %	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	121	2666	2945	8	94	1305	1677	15	431	2431	2710
Intragrupa y off-shore***	0	0	1436	880	0	1	987	535	0	0	1438	836
Otros	121	31	853	1127	94	7	309	389	431	15	681	1003
Total	152	152	4954	4951	102	102	2601	2601	446	446	4549	4549

* 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 intragrupo