

Fecha de Publicación: 20 de Abril de 2011
Fecha de Información: 18 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\$595,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,3%.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	78,4	174,8	162,5	31,0	7,3	42,4	5,0
15-35	85,6	141,6	95,4	18,0	16,2	37,6	30,0
36-60	21,4	26,9	0,0	0,0	26,9	21,4	0,0
61-90	10,1	1,6	0,0	0,0	1,6	10,1	0,0
91-180	4,9	22,5	0,0	0,0	22,5	4,9	0,0
>180	2,2	25,4	3,0	0,0	22,4	2,2	0,0
Total	202,4	392,8	260,9	49,0	96,8	118,4	35,0

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

* 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	18 al 22 de Abril				25 al 29 de Abril				2 al 6 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	80	1327	1706	15	431	2479	2828	2	234	1647	1487
Intragrupa y off-shore***	0	1	1015	558	0	0	1542	844	0	0	626	698
Otros	80	7	310	388	431	15	695	1044	234	2	409	496
Total	87	87	2652	2652	446	446	4716	4716	236	236	2681	2681

* 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