

Fecha de Publicación: 26 de Abril de 2011
Fecha de Información: 20 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\$449,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,8%.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	77,0	161,6	108,0	20,0	14,6	18,0	39,0
15-35	70,2	47,8	22,0	33,3	9,8	20,9	16,0
36-60	6,0	4,4	0,0	0,0	4,4	6,0	0,0
61-90	0,0	22,9	0,0	0,0	22,9	0,0	0,0
91-180	5,1	27,7	0,0	0,0	22,6	0,0	5,1
>180	7,3	19,3	5,0	0,0	14,3	7,3	0,0
Total	165,7	283,6	135,0	53,3	88,5	52,3	60,1

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

* 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

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	99	1340	1685	19	416	2623	3042	4	235	1696	1532
Intragrupa y off-shore***	0	1	1015	570	0	0	1685	958	0	0	638	698
Otros	99	7	289	388	416	19	730	1037	235	4	416	520
Total	107	107	2643	2643	434	434	5038	5038	239	239	2751	2751

* 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