

Fecha de Publicación: 27 de Abril de 2011
Fecha de Información: 25 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\$954,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,6%.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	279,0	219,9	102,0	153,4	16,4	24,1	101,4
15-35	122,6	124,5	87,5	44,0	17,0	58,6	20,0
36-60	38,4	65,4	0,0	0,0	37,4	10,4	28,0
61-90	7,2	32,9	23,6	0,0	9,4	7,2	0,0
91-180	29,1	26,8	20,8	0,0	6,0	29,1	0,0
>180	7,2	1,7	0,0	0,0	1,7	7,2	0,0
Total	483,5	471,2	233,9	197,4	87,9	136,6	149,4

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

* 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	25 al 29 de Abril				2 al 6 de Mayo				9 al 13 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	415	2789	3142	5	235	1743	1635	38	192	1661	1590
Intragrupa y off-shore***	0	0	1753	1079	0	0	705	698	0	0	557	633
Otros	415	17	726	1046	235	5	420	534	192	38	696	690
Total	432	432	5267	5267	240	240	2868	2868	231	231	2913	2913

* 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