

Fecha de Publicación: 28 de Abril de 2011
Fecha de Información: 26 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\$1193,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,5%.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	308,2	190,7	184,5	260,5	6,2	47,7	0,0
15-35	185,4	309,4	170,0	94,0	106,4	58,4	33,0
36-60	78,7	27,1	10,0	10,0	17,1	68,7	0,0
61-90	3,7	7,6	0,1	0,0	7,6	3,7	0,0
91-180	0,1	16,7	0,1	0,0	16,6	0,1	0,0
>180	14,0	51,4	23,0	0,0	23,4	9,0	5,0
Total	590,3	602,9	387,6	364,5	177,3	187,8	38,0

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

* 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	414	3010	3249	5	236	1829	1666	38	193	1664	1736
Intragrupa y off-shore***	0	0	1858	1300	0	0	735	738	0	0	666	633
Otros	414	17	728	1047	236	5	421	581	193	38	734	694
Total	431	431	5596	5596	241	241	2986	2986	231	231	3063	3063

* 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