

Fecha de Publicación: 03 de Mayo de 2011
Fecha de Información: 29 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\$1268,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,7%.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	94,7	72,6	30,5	40,0	16,1	28,7	26,0
15-35	172,6	388,6	185,1	98,2	142,5	13,4	61,0
36-60	94,3	12,9	0,0	0,0	12,9	94,3	0,0
61-90	60,6	35,2	0,0	0,0	32,2	57,6	3,0
91-180	54,0	147,6	90,0	0,0	52,6	49,0	5,0
>180	98,3	36,7	0,0	90,0	36,7	8,3	0,0
Total	574,4	693,6	305,6	228,2	293,1	251,2	95,0

* 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	0,3 %	0,7 %	-0,5 %	0,0 %
15-35	0,2 %	0,9 %	0,2 %	0,7 %
36-60	-	2,1 %	0,1 %	0,3 %
61-90	14,2 %	1,4 %	0,3 %	1,1 %
91-180	0,9 %	0,8 %	0,4 %	0,7 %
>180	-	2,0 %	0,8 %	1,1 %
Total	0,7 %	1,0 %	0,2 %	0,7 %

*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**	18	327	3199	3364	6	287	2079	1872	40	204	1716	1804
Intragrupa y off-shore***	0	0	1875	1454	0	0	852	882	2	0	689	633
Otros	327	18	791	1047	287	6	442	619	202	40	753	720
Total	345	345	5865	5865	293	293	3373	3373	244	244	3158	3158

* 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