

Fecha de Publicación: 04 de Abril de 2011
Fecha de Información: 31 de Marzo 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\$1640,0 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	245,3	228,7	108,9	73,1	25,8	78,2	94,0
15-35	271,3	333,3	71,0	54,1	120,8	75,7	141,5
36-60	6,6	29,5	14,9	0,0	9,6	1,6	5,0
61-90	89,7	55,2	10,0	5,0	15,2	54,7	30,0
91-180	16,0	59,1	30,0	10,0	24,1	1,0	5,0
>180	155,2	150,2	10,0	35,0	25,2	5,2	115,0
Total	784,1	855,9	244,8	177,2	220,6	216,4	390,5

* 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	-4,1 %	-1,2 %	-1,7 %	-2,3 %
15-35	-1,2 %	-1,9 %	-4,3 %	-2,4 %
36-60	0,0 %	-2,5 %	-8,1 %	-2,4 %
61-90	3,6 %	-2,2 %	-2,4 %	-0,8 %
91-180	-2,5 %	-1,7 %	-2,3 %	-1,8 %
>180	0,5 %	0,5 %	2,8 %	1,0 %
Total	-1,0 %	-1,6 %	-2,3 %	-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	28 de Mar. al 1 de Abril				4 al 8 de Abril				11 al 15 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	495	2451	2443	8	176	2232	2354	18	136	1941	1861
Intragrupa y off-shore***	0	0	1200	1127	0	0	1280	976	0	0	676	577
Otros	495	8	579	659	176	8	585	767	136	18	764	940
Total	504	504	4230	4230	183	183	4097	4097	155	155	3381	3378

* 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