

Fecha de Publicación: 29 de Abril de 2011
Fecha de Información: 27 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\$932,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,3%.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	105,1	151,6	72,0	79,0	59,6	6,1	20,0
15-35	225,5	264,7	147,0	136,0	67,7	39,5	50,0
36-60	0,5	7,3	0,0	0,0	7,3	0,5	0,0
61-90	49,6	11,4	0,0	7,0	11,4	42,6	0,0
91-180	24,8	51,3	0,0	5,0	37,3	5,8	14,0
>180	10,6	29,8	12,0	0,0	14,8	7,6	3,0
Total	416,1	516,1	231,0	227,0	198,1	102,1	87,0

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

* 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	357	3100	3315	5	286	1844	1742	39	193	1667	1761
Intragrupa y off-shore***	0	0	1865	1379	0	0	792	738	0	0	674	633
Otros	357	17	777	1048	286	5	430	586	193	39	750	697
Total	374	374	5742	5742	292	292	3066	3066	231	231	3091	3091

* 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