

Fecha de Publicación: 04 de Mayo de 2011
Fecha de Información: 02 de Mayo 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\$1052,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,4%.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	155,4	162,8	105,5	67,0	12,3	43,4	45,0
15-35	183,5	336,3	168,0	86,0	103,3	32,5	65,0
36-60	84,2	16,5	0,0	0,0	16,5	84,2	0,0
61-90	10,2	4,6	0,0	0,0	4,6	10,2	0,0
91-180	35,4	13,6	0,1	0,0	13,5	35,4	0,0
>180	40,5	9,6	5,0	0,0	4,6	40,5	0,0
Total	509,2	543,3	278,6	153,0	154,7	246,2	110,0

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

* 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	2 al 6 de Mayo				9 al 13 de Mayo				16 al 20 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	6	277	2166	1987	40	213	1784	1842	6	138	1085	1001
Intragrupa y off-shore***	0	0	947	930	2	0	699	652	0	0	505	361
Otros	277	6	441	638	211	40	755	744	138	6	308	536
Total	283	283	3555	3555	253	253	3238	3238	144	144	1897	1897

* 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