

Fecha de Publicación: 11 de Mayo de 2011
Fecha de Información: 09 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\$1549,1 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	213,2	220,4	78,5	19,0	39,9	92,2	102,0
15-35	279,0	433,0	187,5	151,0	177,5	60,0	68,0
36-60	85,6	70,2	0,0	16,5	70,2	69,1	0,0
61-90	12,1	0,9	0,0	0,0	0,9	12,1	0,0
91-180	59,9	14,2	0,0	0,0	4,9	50,6	9,3
>180	150,0	10,6	0,0	120,0	10,6	30,0	0,0
Total	799,8	749,3	266,0	306,5	304,0	314,0	179,3

* 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	-12,0 %	0,7 %	-0,3 %	-3,7 %
15-35	1,5 %	1,2 %	0,7 %	1,1 %
36-60	-	1,0 %	0,3 %	0,6 %
61-90	-	3,6 %	0,4 %	0,6 %
91-180	0,5 %	3,8 %	0,7 %	0,9 %
>180	-	2,0 %	0,9 %	1,1 %
Total	-6,2 %	1,1 %	0,4 %	-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	9 al 13 de Mayo				16 al 20 de Mayo				23 al 27 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	186	2257	2339	23	136	1234	1350	4	214	1535	1424
Intragrupa y off-shore***	2	0	913	676	0	2	660	419	0	0	539	535
Otros	184	44	839	995	136	21	438	562	214	4	582	696
Total	230	230	4010	4010	159	159	2331	2331	218	218	2655	2655

* 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