

Fecha de Publicación: 05 de Mayo de 2011
Fecha de Información: 03 de Mayo 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\$1209,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,2%.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	139,1	165,1	136,0	60,4	6,1	55,7	23,0
15-35	282,2	317,1	109,0	124,5	116,1	65,7	92,0
36-60	44,3	56,0	15,0	0,0	11,0	14,3	30,0
61-90	31,5	62,3	0,0	0,0	62,3	31,5	0,0
91-180	14,4	36,0	0,0	0,0	36,0	14,4	0,0
>180	48,2	13,1	0,0	25,0	3,1	13,2	10,0
Total	559,7	649,6	260,0	209,9	234,6	194,8	155,0

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

* 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	226	2236	2089	40	213	1853	1903	6	138	1134	1069
Intragrupa y off-shore***	0	0	992	988	2	0	741	654	0	0	554	400
Otros	226	6	494	645	211	40	756	793	138	6	319	537
Total	231	231	3722	3722	253	253	3349	3349	144	144	2006	2006

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo