

Fecha de Publicación: 06 de Mayo de 2011
Fecha de Información: 04 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\$1603,4 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	232,7	300,8	167,0	37,0	9,8	71,7	124,0
15-35	243,9	402,9	180,0	167,0	160,9	14,9	62,0
36-60	75,0	73,7	0,0	0,0	53,7	55,0	20,0
61-90	53,9	2,0	0,0	0,0	2,0	53,9	0,0
91-180	53,4	4,8	0,0	0,0	4,8	53,4	0,0
>180	112,6	47,6	0,0	95,0	47,6	17,6	0,0
Total	771,6	831,8	347,0	299,0	278,8	266,6	206,0

* 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	-0,1 %	0,0 %	-3,6 %	-0,9 %
15-35	0,0 %	-0,2 %	0,0 %	-0,1 %
36-60	3,4 %	0,3 %	-0,7 %	0,3 %
61-90	-	1,3 %	0,3 %	0,3 %
91-180	-	1,4 %	0,3 %	0,4 %
>180	-	0,9 %	0,6 %	0,7 %
Total	0,3 %	0,0 %	-0,6 %	-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	203	2277	2235	42	213	1978	2027	12	138	1196	1137
Intragrupa y off-shore***	0	0	1101	1013	2	0	799	661	0	0	554	405
Otros	203	6	516	646	212	42	760	849	138	12	340	547
Total	209	209	3894	3894	255	255	3537	3537	150	150	2089	2089

* 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