

Fecha de Publicación: 09 de Mayo de 2011
Fecha de Información: 05 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\$930,9 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	97,8	133,9	43,0	21,0	50,9	36,8	40,0
15-35	210,7	288,5	146,6	90,0	74,9	53,7	67,0
36-60	55,9	16,2	0,0	0,0	16,2	55,9	0,0
61-90	20,6	7,2	0,0	0,0	7,2	20,6	0,0
91-180	11,6	3,2	0,0	0,0	3,2	11,6	0,0
>180	73,7	11,6	0,0	66,0	6,6	2,7	5,0
Total	470,3	460,6	189,6	177,0	159,0	181,3	112,0

* 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 %	0,5 %	-0,3 %	0,1 %
15-35	0,5 %	0,2 %	-0,1 %	0,2 %
36-60	-	0,3 %	-0,2 %	-0,1 %
61-90	-	1,1 %	0,3 %	0,5 %
91-180	-	1,6 %	0,6 %	0,8 %
>180	0,8 %	1,5 %	0,8 %	0,9 %
Total	0,4 %	0,4 %	0,0 %	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	196	2308	2296	42	214	2034	2054	14	138	1205	1202
Intragrupa y off-shore***	0	0	1140	1024	2	0	789	671	0	0	585	405
Otros	196	6	518	646	212	42	777	875	138	14	374	556
Total	202	202	3967	3967	256	256	3599	3599	152	152	2163	2163

* 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