

Fecha de Publicación: 13 de Mayo de 2011
Fecha de Información: 11 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\$1490,8 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	145,2	217,0	181,0	80,1	16,0	45,1	20,0
15-35	307,0	459,5	280,6	177,0	94,9	46,0	84,0
36-60	99,1	55,7	35,0	0,0	0,7	79,1	20,0
61-90	67,9	2,4	0,0	0,6	2,4	67,3	0,0
91-180	43,5	24,5	0,0	17,0	4,5	6,5	20,0
>180	31,1	37,8	0,0	20,0	37,8	11,1	0,0
Total	693,8	797,0	496,6	294,7	156,4	255,1	144,0

* 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	0,6 %	0,4 %	-0,3 %	0,1 %
15-35	-1,3 %	0,7 %	0,3 %	0,3 %
36-60	0,2 %	3,8 %	-1,0 %	-0,7 %
61-90	-	1,6 %	0,4 %	0,4 %
91-180	0,6 %	1,4 %	0,3 %	0,6 %
>180	-	1,1 %	0,6 %	0,9 %
Total	-0,6 %	0,7 %	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	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	151	2396	2567	23	146	1457	1537	4	214	1553	1537
Intragrupa y off-shore***	2	0	1092	763	0	2	749	539	0	0	599	535
Otros	150	44	848	1006	146	21	478	608	214	4	626	705
Total	196	196	4336	4336	169	169	2683	2683	218	218	2777	2777

* 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