

Fecha de Publicación: 17 de Mayo de 2011
Fecha de Información: 13 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\$1441,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	92,5	117,7	50,0	11,0	37,7	51,5	30,0
15-35	235,6	596,6	374,5	119,0	144,1	38,6	78,0
36-60	37,6	80,3	0,0	0,0	80,3	37,6	0,0
61-90	41,4	40,3	30,0	0,0	10,3	41,4	0,0
91-180	67,7	15,6	0,0	29,0	15,6	38,7	0,0
>180	70,6	46,1	0,0	65,0	46,1	5,6	0,0
Total	545,4	896,5	454,5	224,0	334,0	213,4	108,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,4 %	1,1 %	-0,1 %	0,5 %
15-35	0,6 %	0,9 %	0,4 %	0,7 %
36-60	-	1,5 %	0,2 %	1,1 %
61-90	-	0,9 %	0,5 %	0,7 %
91-180	-	1,3 %	0,3 %	0,5 %
>180	-	1,1 %	0,9 %	1,0 %
Total	0,6 %	1,0 %	0,4 %	0,8 %

*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

Sectores	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**	17	177	2525	2598	24	153	1624	1673	4	214	1655	1660
Intragruppo y off-shore***	2	0	1114	855	0	2	820	667	0	0	641	542
Otros	175	17	847	1033	153	22	522	626	214	4	666	760
Total	194	194	4486	4486	177	177	2966	2966	218	218	2962	2962

* 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 intragruppo