

Fecha de Publicación: 18 de Mayo de 2011
Fecha de Información: 16 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\$1399,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,5%.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	60,4	223,8	153,5	0,0	26,3	16,4	44,0
15-35	378,0	312,0	164,0	237,0	64,0	57,0	84,0
36-60	103,6	89,5	76,0	0,0	3,5	93,6	10,0
61-90	0,4	23,0	0,0	0,0	23,0	0,4	0,0
91-180	22,4	78,3	70,0	0,0	8,3	22,4	0,0
>180	87,4	20,8	5,0	15,0	0,8	57,4	15,0
Total	652,3	747,3	468,5	252,0	125,8	247,3	153,0

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

* 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	16 al 20 de Mayo				23 al 27 de Mayo				30 de May. al 3 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	139	1669	1812	6	214	1674	1754	4	287	1553	1878
Intragrupa y off-shore***	0	2	891	667	0	0	723	542	0	0	888	697
Otros	139	22	555	636	214	6	669	769	287	4	665	530
Total	163	163	3115	3115	220	220	3066	3066	291	291	3106	3106

* 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