

Fecha de Publicación: 25 de Mayo de 2011
 Fecha de Información: 23 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\$1364,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,0%.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	100,9	109,3	38,0	73,5	56,3	12,4	15,0
15-35	395,2	324,5	178,0	204,0	49,5	94,2	97,0
36-60	92,7	198,1	137,0	0,0	1,1	32,7	60,0
61-90	8,4	0,1	0,0	0,0	0,1	8,4	0,0
91-180	42,6	58,0	40,0	0,0	18,0	42,6	0,0
>180	10,1	24,5	3,0	0,0	21,5	10,1	0,0
Total	649,9	714,6	396,0	277,5	146,6	200,4	172,0

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

* 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	23 al 27 de Mayo				30 de May. al 3 de Junio				6 al 10 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	212	2069	2233	5	303	1689	2065	4	172	1853	2085
Intragrupa y off-shore***	0	0	901	680	0	0	965	742	0	0	940	785
Otros	212	8	847	903	303	5	727	574	172	4	647	569
Total	221	221	3816	3816	309	309	3381	3381	177	177	3440	3440

* 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