

Fecha de Publicación: 28 de Junio de 2011
 Fecha de Información: 23 de Junio 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\$1586,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,0%.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	221,1	189,7	93,8	109,5	75,9	91,6	20,0
15-35	435,9	516,2	346,2	245,6	79,4	99,7	90,7
36-60	9,4	44,7	40,0	0,0	4,7	9,4	0,0
61-90	43,6	4,1	0,0	0,0	4,1	43,6	0,0
91-180	96,7	23,6	20,0	50,0	3,6	46,7	0,0
>180	0,0	1,4	0,0	0,0	1,4	0,0	0,0
Total	806,7	779,6	500,0	405,1	168,9	291,0	110,7

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

* 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	20 al 24 de Junio				27 de Jun. al 1 de Julio				4 al 8 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	158	2712	2709	14	417	2252	2230	4	169	1704	1689
Intragrupa y off-shore***	5	1	1497	1101	0	0	1078	1082	14	0	927	608
Otros	153	21	528	927	417	14	742	761	155	4	425	759
Total	181	181	4737	4737	431	431	4072	4072	173	173	3056	3056

* 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