

Fecha de Publicación: 6 de Julio de 2011
Fecha de Información: 01 de Julio 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\$1581,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.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	178,3	292,6	125,5	72,5	65,1	3,8	102,0
15-35	320,5	418,3	188,0	202,5	173,3	61,0	57,0
36-60	5,1	35,4	0,0	0,0	33,4	3,1	2,0
61-90	14,0	49,6	0,0	5,0	49,6	9,0	0,0
91-180	117,1	75,3	0,0	60,0	75,3	57,1	0,0
>180	63,0	12,3	0,0	63,0	12,3	0,0	0,0
Total	698,0	883,6	313,5	403,0	409,1	134,0	161,0

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

Sector	27 de Jun. al 1 de Julio				4 al 8 de Julio				11 al 15 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	376	2562	2505	8	174	2107	2083	4	160	1973	2306
Intragrupa y off-shore***	0	0	1303	1285	14	0	1105	792	0	0	1574	768
Otros	376	15	751	826	160	8	520	856	160	4	471	945
Total	391	391	4616	4616	181	181	3731	3731	164	164	4019	4019

* 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