

Fecha de Publicación: 04 de Junio de 2011
 Fecha de Información: 02 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\$1662,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,5%.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	239,0	353,6	222,5	110,5	46,1	43,5	85,0
15-35	303,9	549,2	218,6	85,0	159,6	47,9	171,0
36-60	11,9	2,5	0,0	1,2	2,5	10,7	0,0
61-90	11,9	5,5	0,0	0,0	5,5	11,9	0,0
91-180	42,4	24,4	20,0	0,0	4,4	42,4	0,0
>180	73,1	45,4	15,0	32,0	10,4	21,1	20,0
Total	682,1	980,5	476,1	228,7	228,4	177,4	276,0

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

* 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	30 de May. al 3 de Junio				6 al 10 de Junio				13 al 17 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	320	2461	2683	5	182	2459	2627	8	196	2252	2693
Intragrupa y off-shore***	0	0	1392	1170	0	0	1113	1027	0	0	1569	938
Otros	320	7	746	745	182	5	802	720	195	8	656	846
Total	327	327	4598	4598	187	187	4374	4374	203	203	4477	4477

* 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