

Fecha de Publicación: 10 de Junio de 2011
Fecha de Información: 08 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\$995,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.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	118,3	126,2	51,2	80,3	43,0	6,0	32,0
15-35	217,4	354,4	152,7	87,5	93,7	21,9	108,0
36-60	0,1	13,6	0,0	0,0	13,6	0,1	0,0
61-90	74,5	15,5	5,0	0,0	10,5	74,5	0,0
91-180	2,6	18,7	10,0	0,0	8,7	2,6	0,0
>180	31,6	22,4	10,0	25,0	12,4	6,6	0,0
Total	444,4	550,7	228,9	192,8	181,8	111,6	140,0

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

* 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	6 al 10 de Junio				13 al 17 de Junio				20 al 24 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	174	2696	2788	12	200	2402	2870	9	189	2432	2044
Intragrupa y off-shore***	0	0	1264	1241	3	0	1639	1017	0	0	945	1003
Otros	174	8	805	736	197	12	721	874	189	9	454	783
Total	182	182	4765	4765	212	212	4761	4761	199	199	3831	3831

* 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