

Fecha de Publicación: 13 de Junio de 2011
Fecha de Información: 09 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\$1353,3 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	238,5	244,1	223,5	165,0	14,6	67,5	6,0
15-35	276,3	412,8	304,5	199,0	51,3	20,3	57,0
36-60	7,9	51,9	0,0	0,0	51,9	7,9	0,0
61-90	24,0	23,3	8,0	0,0	10,3	19,0	5,0
91-180	35,3	16,7	0,0	0,0	16,7	35,3	0,0
>180	0,1	22,3	0,0	0,0	22,3	0,1	0,0
Total	582,1	771,2	536,0	364,0	167,2	150,1	68,0

* 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	0,2 %	0,9 %	0,1 %	0,2 %
15-35	0,6 %	0,6 %	0,2 %	0,5 %
36-60	-	1,5 %	0,2 %	1,3 %
61-90	0,4 %	0,9 %	0,5 %	0,7 %
91-180	-	1,5 %	0,8 %	1,0 %
>180	-	1,0 %	0,7 %	1,0 %
Total	0,5 %	0,8 %	0,2 %	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	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	171	2761	2831	12	199	2552	2927	10	190	2458	2203
Intragrupa y off-shore***	0	0	1301	1306	3	0	1695	1117	0	0	1075	1003
Otros	171	8	810	736	196	12	718	921	190	10	480	806
Total	179	179	4872	4872	211	211	4965	4965	200	200	4012	4012

* 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