

Fecha de Publicación: 15 de Junio de 2011
Fecha de Información: 13 de Junio de 2011¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$868,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,6%.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	111,9	98,9	76,0	63,8	6,9	32,2	16,0
15-35	206,2	215,7	132,6	126,0	70,1	67,2	13,0
36-60	76,0	57,7	33,0	0,0	24,7	76,0	0,0
61-90	0,1	12,6	0,0	0,0	12,6	0,1	0,0
91-180	65,2	13,9	0,0	0,0	13,9	65,2	0,0
>180	3,6	6,6	0,0	0,0	6,6	3,6	0,0
Total	463,0	405,4	241,6	189,8	134,8	244,2	29,0

* 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 %	0,6 %	-0,2 %	0,1 %
15-35	0,8 %	0,8 %	0,4 %	0,6 %
36-60	-	0,9 %	0,8 %	0,8 %
61-90	-	1,7 %	0,5 %	1,7 %
91-180	-	1,8 %	0,7 %	0,9 %
>180	-	1,9 %	1,2 %	1,7 %
Total	0,6 %	0,9 %	0,4 %	0,6 %

* 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	13 al 17 de Junio				20 al 24 de Junio				27 de Jun. al 1 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	146	2750	3155	15	189	2465	2240	5	414	1775	1713
Intragrupa y off-shore***	3	0	1820	1253	0	1	1108	996	0	0	850	857
Otros	142	15	802	964	189	13	485	820	414	5	563	618
Total	161	161	5372	5372	204	204	4057	4057	420	420	3188	3188

* 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