

Fecha de Publicación: 16 de Junio de 2011
Fecha de Información: 14 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\$1095,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.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	164,3	128,9	91,0	150,0	37,9	14,3	0,0
15-35	180,7	385,6	291,7	133,5	59,9	13,3	34,0
36-60	50,2	42,6	13,0	0,0	29,6	50,2	0,0
61-90	4,2	13,6	0,0	0,0	13,6	4,2	0,0
91-180	42,1	22,3	0,0	0,0	22,3	42,1	0,0
>180	8,6	52,8	0,0	0,0	52,8	8,6	0,0
Total	450,0	645,8	395,7	283,5	216,1	132,6	34,0

* 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	-	3,5 %	2,4 %	2,8 %
15-35	0,7 %	1,7 %	1,2 %	1,5 %
36-60	-	1,3 %	0,2 %	0,6 %
61-90	-	1,4 %	0,7 %	1,2 %
91-180	-	1,6 %	1,0 %	1,2 %
>180	-	1,6 %	1,0 %	1,5 %
Total	0,7 %	1,9 %	1,5 %	1,7 %

* 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**	16	134	2912	3247	15	189	2466	2280	6	414	1776	1823
Intragrupa y off-shore***	3	0	1884	1403	0	1	1135	996	0	0	935	857
Otros	131	16	829	975	189	13	497	821	414	6	588	619
Total	150	150	5625	5625	204	204	4098	4098	419	419	3299	3299

* 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