

Fecha de Publicación: 17 de Junio de 2011
Fecha de Información: 15 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\$1244,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.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	219,7	134,9	88,0	64,0	15,4	124,2	31,5
15-35	270,9	438,0	299,0	87,7	34,5	78,7	104,5
36-60	24,1	2,9	0,0	0,0	2,9	24,1	0,0
61-90	28,3	3,5	0,0	0,0	3,5	28,3	0,0
91-180	28,2	61,1	0,0	5,0	61,1	23,2	0,0
>180	23,9	9,3	0,0	20,0	9,3	3,9	0,0
Total	595,1	649,6	387,0	176,7	126,6	282,4	136,0

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

* 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	130	2985	3275	15	185	2562	2372	6	414	1866	1911
Intragrupa y off-shore***	3	0	1910	1436	0	1	1197	1011	0	0	990	898
Otros	127	16	831	1016	185	13	501	877	414	6	608	655
Total	146	146	5727	5727	200	200	4260	4260	420	420	3464	3464

* 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