

Fecha de Publicación: 20 de Junio de 2011
Fecha de Información: 16 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\$1052,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,2%.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	74,9	207,9	161,5	22,0	40,4	46,9	6,0
15-35	178,2	314,1	249,5	143,0	59,6	30,2	5,0
36-60	6,7	31,0	0,0	0,0	31,0	6,7	0,0
61-90	54,6	37,8	12,2	0,0	12,6	41,6	13,0
91-180	31,4	64,8	60,0	0,0	4,8	31,4	0,0
>180	35,8	15,2	15,0	11,0	0,2	24,8	0,0
Total	381,6	670,9	498,2	176,0	148,7	181,6	24,0

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

* 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	121	3013	3324	15	183	2591	2494	6	414	1905	1959
Intragrupa y off-shore***	3	0	1950	1439	0	1	1313	1030	0	0	995	923
Otros	118	16	840	1041	183	14	507	886	414	6	645	664
Total	137	137	5804	5804	199	199	4411	4411	419	419	3545	3545

* 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