

Fecha de Publicación: 21 de Junio de 2011
Fecha de Información: 17 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\$904,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	43,4	30,6	0,0	10,0	10,6	13,4	20,0
15-35	298,0	222,7	149,5	134,2	9,2	99,8	64,0
36-60	26,2	20,8	0,0	0,0	20,8	26,2	0,0
61-90	66,4	13,1	0,0	0,0	13,1	66,4	0,0
91-180	32,9	76,0	45,0	0,0	11,0	12,9	20,0
>180	0,1	73,7	72,8	0,0	1,0	0,1	0,0
Total	467,0	437,0	267,3	144,2	65,7	218,8	104,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,6 %	2,0 %	0,0 %	0,6 %
15-35	0,3 %	1,1 %	0,7 %	0,8 %
36-60	-	2,3 %	1,0 %	1,6 %
61-90	-	1,4 %	0,9 %	1,0 %
91-180	0,7 %	0,8 %	1,0 %	0,8 %
>180	-	1,3 %	1,0 %	1,3 %
Total	0,4 %	1,2 %	0,7 %	0,9 %

* 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	122	3056	3345	21	184	2604	2510	6	414	1920	1961
Intragruppo y off-shore***	3	0	1971	1460	0	1	1313	1030	0	0	985	923
Otros	118	16	840	1063	184	19	513	889	414	6	647	668
Total	138	138	5868	5868	204	204	4430	4430	419	419	3552	3552

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo