

Fecha de Publicación: 22 de Junio de 2011
Fecha de Información: 20 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\$1037,2 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	53,5	130,1	97,0	25,0	33,1	28,5	0,0
15-35	311,5	283,9	173,5	197,6	72,4	76,0	38,0
36-60	34,6	4,0	0,0	0,0	4,0	34,6	0,0
61-90	42,1	0,6	0,0	0,0	0,6	42,1	0,0
91-180	93,5	69,1	40,0	0,0	29,1	93,5	0,0
>180	5,5	8,8	5,0	0,0	3,8	5,5	0,0
Total	540,8	496,4	315,5	222,6	142,9	280,2	38,0

* 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	-	2,0 %	1,7 %	1,9 %
15-35	1,5 %	1,3 %	1,0 %	1,1 %
36-60	-	1,7 %	1,0 %	1,1 %
61-90	-	3,2 %	1,0 %	1,1 %
91-180	-	1,1 %	1,0 %	1,0 %
>180	-	2,8 %	1,3 %	1,9 %
Total	1,5 %	1,4 %	1,1 %	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	20 al 24 de Junio				27 de Jun. al 1 de Julio				4 al 8 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	187	2638	2555	7	414	1937	2040	3	169	1588	1487
Intragrupa y off-shore***	0	1	1363	1040	0	0	1032	938	14	0	831	558
Otros	187	20	508	914	414	7	679	670	155	3	337	709
Total	208	208	4509	4509	421	421	3648	3648	172	172	2755	2755

* 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