

Fecha de Publicación: 3 de Agosto de 2011
Fecha de Información: 01 de Agosto 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\$983,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.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	160,0	75,6	41,0	113,4	0,6	12,6	34,0
15-35	210,9	368,6	262,1	105,0	68,5	67,9	38,0
36-60	57,8	41,1	20,0	0,0	21,1	57,8	0,0
61-90	0,3	6,3	0,0	0,0	6,3	0,3	0,0
91-180	0,3	36,2	20,0	0,1	16,2	0,3	0,0
>180	13,0	13,3	10,0	0,0	0,3	10,0	3,0
Total	442,4	541,1	353,1	218,5	113,0	149,0	75,0

* 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	1,6 %	0,4 %	0,1 %	0,4 %
15-35	0,9 %	1,2 %	0,7 %	1,0 %
36-60	-	0,9 %	1,2 %	1,1 %
61-90	-	1,9 %	-0,2 %	1,8 %
91-180	-	1,3 %	0,2 %	1,3 %
>180	1,5 %	1,0 %	1,1 %	1,1 %
Total	1,3 %	1,1 %	0,6 %	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	1 al 5 de Agosto				8 al 12 de Agosto				15 al 19 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	210	1973	2277	10	146	2305	2236	4	89	1476	1790
Intragrupa y off-shore***	0	0	1389	864	0	1	979	855	0	0	1103	435
Otros	210	7	461	682	146	8	562	755	89	4	399	754
Total	217	217	3824	3824	156	156	3846	3846	92	92	2979	2979

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo