

Fecha de Publicación: 04 de Agosto de 2011
Fecha de Información: 02 de Agosto 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\$1585,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,7%.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	232,7	152,4	85,5	149,0	21,9	38,7	45,0
15-35	275,9	447,8	161,0	99,0	190,8	80,9	96,0
36-60	29,0	19,6	0,0	1,3	4,6	12,7	15,0
61-90	87,0	58,9	0,0	0,0	28,9	57,0	30,0
91-180	145,8	105,6	20,0	0,0	4,6	64,8	81,0
>180	0,0	31,3	30,0	0,0	1,3	0,0	0,0
Total	770,3	815,6	296,5	249,3	252,1	254,0	267,0

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

* 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**	12	210	2117	2333	11	146	2370	2332	8	89	1499	1839
Intragrupa y off-shore***	0	0	1442	1004	0	1	1012	864	0	0	1106	435
Otros	210	12	463	686	146	10	581	767	89	8	445	777
Total	222	222	4023	4023	158	158	3963	3963	97	97	3051	3051

* 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