

Fecha de Publicación: 05 de Agosto de 2011
 Fecha de Información: 03 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\$1480,8 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	351,9	244,3	77,0	255,0	81,3	10,9	86,0
15-35	306,7	395,2	251,0	154,7	52,2	59,9	92,0
36-60	5,7	41,3	10,0	0,0	31,3	5,7	0,0
61-90	5,7	11,7	5,0	0,0	6,7	5,7	0,0
91-180	20,1	85,5	75,0	0,0	10,5	20,1	0,0
>180	5,7	7,1	0,0	5,0	7,1	0,7	0,0
Total	695,7	785,1	418,0	414,7	189,1	102,9	178,0

* 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	0,4 %	1,2 %	0,2 %	0,6 %
15-35	0,5 %	1,0 %	0,6 %	0,8 %
36-60	-	1,3 %	0,5 %	1,2 %
61-90	-	0,8 %	0,3 %	0,7 %
91-180	-	1,1 %	0,9 %	1,0 %
>180	-	1,3 %	1,1 %	1,2 %
Total	0,5 %	1,1 %	0,5 %	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	199	2235	2412	11	146	2597	2448	8	89	1507	1901
Intragrupa y off-shore***	0	0	1506	1108	0	1	1025	1015	0	0	1116	435
Otros	199	12	466	686	146	10	611	769	89	8	497	785
Total	212	212	4206	4206	158	158	4232	4232	97	97	3121	3121

* 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