

Fecha de Publicación: 10 de Agosto de 2011
 Fecha de Información: 08 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\$999,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,1%.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	90,5	142,9	50,5	32,5	66,4	32,0	26,0
15-35	224,6	297,2	187,0	132,0	63,7	46,1	46,5
36-60	25,4	11,2	10,0	0,0	1,2	25,4	0,0
61-90	9,5	0,8	0,0	0,0	0,8	9,5	0,0
91-180	78,1	77,1	0,0	0,0	54,2	55,2	22,9
>180	29,1	12,9	0,0	0,0	12,9	29,1	0,0
Total	457,2	542,0	247,5	164,5	199,1	197,3	95,4

* 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	3,6 %	2,3 %	0,6 %	2,0 %
15-35	2,4 %	2,0 %	3,0 %	2,4 %
36-60	-	0,3 %	1,7 %	1,3 %
61-90	-	3,1 %	1,6 %	1,7 %
91-180	1,4 %	2,3 %	1,5 %	1,8 %
>180	-	1,8 %	1,3 %	1,5 %
Total	2,5 %	2,1 %	2,0 %	2,1 %

* 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	8 al 12 de Agosto				15 al 19 de Agosto				22 al 26 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	133	2754	2730	12	99	1614	2088	15	132	1529	1433
Intragrupa y off-shore***	0	1	1208	1068	8	0	1187	494	0	0	793	417
Otros	133	8	701	865	92	12	595	813	132	15	298	771
Total	143	143	4663	4663	111	111	3396	3396	147	147	2621	2621

* 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