

Fecha de Publicación: 11 de Agosto de 2011
Fecha de Información: 09 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\$1463,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,5%.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	203,9	222,8	152,0	102,2	22,8	53,7	48,0
15-35	399,1	425,1	183,8	229,5	114,3	42,6	127,0
36-60	32,0	21,6	0,0	0,0	0,6	11,0	21,0
61-90	7,1	2,3	0,0	0,0	2,3	7,1	0,0
91-180	25,1	28,9	0,0	2,1	28,9	23,0	0,0
>180	166,0	192,8	101,5	30,0	24,3	69,0	67,0
Total	833,2	893,5	437,3	363,8	193,2	206,4	263,0

* 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	0,3 %	0,8 %	0,9 %	0,8 %
15-35	2,6 %	2,5 %	0,9 %	1,9 %
36-60	2,1 %	3,5 %	1,9 %	2,1 %
61-90	-	3,1 %	1,7 %	2,1 %
91-180	-	2,1 %	1,2 %	1,7 %
>180	1,4 %	1,3 %	1,5 %	1,4 %
Total	1,8 %	1,8 %	1,1 %	1,5 %

* 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	137	2852	2899	12	98	1700	2131	16	132	1535	1481
Intragrupa y off-shore***	0	1	1356	1128	8	0	1191	537	0	0	795	417
Otros	137	8	692	873	91	12	615	839	132	16	344	777
Total	147	147	4900	4900	110	110	3506	3506	148	148	2674	2674

* 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 El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.