

Fecha de Publicación: 16 de Agosto de 2011
Fecha de Información: 11 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\$1000,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,0%.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	78,9	111,2	62,0	59,3	45,2	15,6	4,0
15-35	317,0	406,2	315,4	77,0	42,8	192,0	48,0
36-60	14,0	4,4	2,0	0,0	2,4	14,0	0,0
61-90	2,1	22,6	0,0	0,0	21,8	1,3	0,8
91-180	18,4	28,9	10,0	0,0	18,9	18,4	0,0
>180	27,6	22,3	0,0	5,0	22,3	22,6	0,0
Total	458,1	595,6	389,4	141,3	153,4	264,0	52,8

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

* 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**	9	124	2995	2956	15	98	1798	2241	17	134	1601	1642
Intragrupa y off-shore***	0	1	1392	1248	8	0	1227	602	0	0	830	438
Otros	124	8	703	886	91	15	655	838	134	17	430	782
Total	134	134	5090	5090	113	113	3681	3681	151	151	2861	2861

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.