

Fecha de Publicación: 14 de Agosto de 2011
Fecha de Información: 12 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\$1078,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,8%.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	124,2	148,1	105,0	87,0	31,1	25,2	12,0
15-35	255,4	282,0	191,8	142,0	32,2	55,4	58,0
36-60	11,3	27,7	25,0	0,0	2,7	11,3	0,0
61-90	3,6	38,0	25,0	0,0	13,0	3,6	0,0
91-180	84,4	96,9	55,0	0,0	11,9	54,4	30,0
>180	90,0	17,0	0,0	80,0	17,0	10,0	0,0
Total	568,9	609,7	401,8	309,0	107,9	159,9	100,0

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

* 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	112	2995	2969	15	85	1861	2370	18	134	1664	1672
Intragrupa y off-shore***	0	1	1402	1248	8	0	1332	650	0	0	830	480
Otros	112	8	706	886	77	15	680	853	134	18	449	791
Total	121	121	5103	5103	100	100	3873	3873	152	152	2942	2942

* 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.