

Fecha de Publicación: 22 de Agosto de 2011
Fecha de Información: 18 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\$1251,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,2%.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	84,6	132,2	100,0	51,0	22,2	23,6	10,0
15-35	357,4	529,7	351,5	154,0	82,2	107,4	96,0
36-60	15,4	1,9	0,0	0,0	1,9	15,4	0,0
61-90	45,2	40,3	15,0	0,0	10,3	30,2	15,0
91-180	90,6	50,0	0,0	5,0	10,0	45,6	40,0
>180	28,9	36,5	0,0	0,0	36,5	28,9	0,0
Total	622,0	790,6	466,5	210,0	163,1	251,1	161,0

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

* 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	15 al 19 de Agosto				22 al 26 de Agosto				29 de Ago. al 2 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	85	1994	2470	25	139	1887	1886	9	189	2007	2266
Intragrupa y off-shore***	8	0	1424	724	0	0	943	581	0	0	1259	796
Otros	77	16	683	907	139	25	465	827	189	9	564	768
Total	101	101	4101	4101	164	164	3294	3294	198	198	3830	3830

* 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.