

Fecha de Publicación: 25 de Agosto de 2011
Fecha de Información: 23 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\$1175,0 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	186,1	144,4	98,3	98,3	36,1	77,8	10,0
15-35	209,6	367,2	272,3	125,3	64,9	54,3	30,0
36-60	39,3	7,2	0,0	0,0	7,2	39,3	0,0
61-90	18,2	5,0	0,0	0,0	5,0	18,2	0,0
91-180	75,9	115,2	35,0	0,0	50,2	45,9	30,0
>180	27,4	59,6	20,0	15,0	29,6	2,4	10,0
Total	556,5	698,5	425,6	238,6	193,0	238,0	80,0

* 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	0,4 %	1,8 %	0,2 %	0,8 %
15-35	3,0 %	2,7 %	1,8 %	2,4 %
36-60	-	3,3 %	2,1 %	2,3 %
61-90	-	2,5 %	2,5 %	2,5 %
91-180	2,1 %	1,7 %	2,1 %	1,9 %
>180	1,9 %	2,1 %	1,9 %	2,0 %
Total	2,2 %	2,4 %	1,4 %	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	22 al 26 de Agosto				29 de Ago. al 2 de Septiembre				5 al 9 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	125	2140	2011	10	192	2131	2426	6	72	2394	2582
Intragrupa y off-shore***	0	0	1000	746	0	0	1371	854	0	0	1541	917
Otros	125	27	516	899	192	10	587	809	72	6	517	954
Total	152	152	3656	3656	201	201	4089	4089	78	78	4452	4452

* 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.