

Fecha de Publicación: 26 de Agosto de 2011
 Fecha de Información: 24 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\$1254,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	278,6	137,0	32,7	167,0	27,3	34,6	77,0
15-35	311,4	419,8	187,0	168,0	131,8	42,4	101,0
36-60	8,0	0,3	0,0	0,0	0,3	8,0	0,0
61-90	34,7	40,7	15,0	0,0	10,7	19,7	15,0
91-180	94,6	92,5	40,0	0,0	32,5	74,6	20,0
>180	28,2	21,4	0,0	5,0	21,4	23,2	0,0
Total	755,6	711,6	274,7	340,0	223,9	202,6	213,0

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

* 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	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	121	2213	2037	11	190	2292	2498	6	72	2460	2726
Intragrupa y off-shore***	0	0	1014	812	0	0	1390	955	0	0	1541	917
Otros	121	27	522	899	190	11	610	839	72	6	599	958
Total	148	148	3748	3748	201	201	4292	4292	78	78	4601	4601

* 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.