

Fecha de Publicación: 29 de Agosto de 2011
Fecha de Información: 25 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\$1309,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,3%.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	212,6	181,4	93,8	157,5	72,6	40,1	15,0
15-35	363,5	323,1	208,0	207,0	37,4	78,8	77,7
36-60	11,1	17,9	16,9	0,6	1,0	10,5	0,0
61-90	38,8	68,8	57,0	0,0	1,8	28,8	10,0
91-180	61,0	40,3	32,3	0,0	8,0	61,0	0,0
>180	16,2	77,6	75,0	0,0	2,6	16,2	0,0
Total	703,3	709,3	483,0	365,1	123,6	235,5	102,7

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

* 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**	24	118	2254	2045	12	191	2406	2554	6	74	2534	2844
Intragrupa y off-shore***	0	0	1022	847	0	0	1424	1042	0	0	1593	968
Otros	118	24	521	905	191	12	633	865	74	6	650	966
Total	142	142	3797	3797	203	203	4462	4462	80	80	4777	4777

* 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.