

Fecha de Publicación: 12 de Julio de 2011
Fecha de Información: 08 de Julio 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\$1223,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.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	47,0	190,9	105,9	25,0	80,0	17,0	5,0
15-35	227,0	376,6	194,5	109,0	81,1	17,0	101,0
36-60	0,9	6,3	0,0	0,0	6,3	0,9	0,0
61-90	101,1	50,1	10,0	5,0	30,1	86,1	10,0
91-180	20,9	74,6	10,0	0,0	44,6	0,9	20,0
>180	100,0	28,1	0,0	90,0	18,1	0,0	10,0
Total	496,9	726,6	320,4	229,0	260,2	121,9	146,0

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

* 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	4 al 8 de Julio				11 al 15 de Julio				18 al 22 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	99	2148	2212	7	165	2198	2770	4	65	1858	2117
Intragrupa y off-shore***	0	0	1176	798	0	0	1685	859	0	0	1411	811
Otros	99	9	546	861	165	7	730	983	64	4	398	740
Total	108	108	3870	3870	172	172	4613	4613	68	68	3667	3667

* 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 La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo