

Fecha de Publicación: 18 de Julio de 2011
Fecha de Información: 14 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\$1156,0 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	118,2	89,0	20,0	74,0	32,7	7,9	36,3
15-35	183,9	466,7	400,0	118,8	29,4	27,8	37,3
36-60	66,0	13,7	0,0	0,0	13,7	66,0	0,0
61-90	91,3	45,5	25,0	0,0	20,5	91,3	0,0
91-180	10,6	51,0	0,0	10,0	50,8	0,4	0,2
>180	10,0	10,1	0,0	5,0	5,1	0,0	5,0
Total	480,0	676,1	445,0	207,8	152,2	193,4	78,8

* 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	1,3 %	1,8 %	8,2 %	4,8 %
15-35	1,4 %	1,5 %	2,2 %	1,7 %
36-60	-	2,2 %	1,2 %	1,4 %
61-90	-	1,5 %	1,2 %	1,3 %
91-180	1,7 %	1,8 %	1,5 %	1,8 %
>180	1,5 %	1,6 %	1,5 %	1,5 %
Total	1,3 %	1,6 %	3,2 %	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	11 al 15 de Julio				18 al 22 de Julio				25 al 29 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	143	2499	2894	15	66	2097	2285	7	198	1957	1958
Intragrupa y off-shore***	0	0	1757	1085	0	1	1452	867	0	0	885	738
Otros	143	12	743	1020	66	14	425	821	198	7	568	715
Total	155	155	5000	4999	81	81	3974	3974	205	205	3410	3410

* 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