

Fecha de Publicación: 18 de Julio de 2011
Fecha de Información: 15 de Julio 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\$1143,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,5%.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	133,8	148,6	91,5	90,0	42,1	28,8	15,0
15-35	344,1	358,3	158,8	128,0	96,6	113,1	103,0
36-60	5,7	21,9	0,0	0,0	21,9	5,7	0,0
61-90	6,0	6,1	0,0	0,0	6,1	6,0	0,0
91-180	40,0	43,6	0,0	0,0	43,6	40,0	0,0
>180	16,4	18,8	0,0	5,0	8,8	1,4	10,0
Total	546,0	597,4	250,3	223,0	219,1	195,0	128,0

* 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	0,0 %	1,9 %	-10,9 %	-4,0 %
15-35	1,4 %	1,5 %	1,4 %	1,4 %
36-60	-	2,1 %	1,8 %	2,0 %
61-90	-	2,4 %	1,2 %	1,8 %
91-180	-	0,9 %	0,9 %	0,9 %
>180	1,4 %	2,2 %	1,4 %	1,7 %
Total	1,3 %	1,5 %	-1,0 %	0,5 %

* 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**	15	139	2497	2895	15	67	2201	2383	7	198	1966	2008
Intragrupa y off-shore***	0	0	1757	1085	0	1	1538	957	0	0	890	738
Otros	139	15	745	1018	67	14	426	825	198	7	608	718
Total	153	153	4998	4998	82	82	4165	4165	205	205	3464	3464

* 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