

Fecha de Publicación: 21 de Julio de 2011
Fecha de Información: 18 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\$862,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.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	65,2	61,9	2,0	5,0	13,9	14,2	46,0
15-35	267,6	289,5	91,0	63,0	47,5	53,6	151,0
36-60	16,2	4,8	0,0	0,0	4,8	16,2	0,0
61-90	45,0	23,2	0,0	0,0	13,2	35,0	10,0
91-180	18,0	27,1	0,0	0,0	22,1	13,0	5,0
>180	30,0	13,7	0,0	20,0	3,7	0,0	10,0
Total	442,1	420,2	93,0	88,0	105,2	132,1	222,0

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

* 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	18 al 22 de Julio				25 al 29 de Julio				1 al 5 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	71	2231	2393	7	198	1993	2038	4	199	1549	1899
Intragrupa y off-shore***	0	1	1538	962	0	0	890	738	0	0	1268	601
Otros	71	9	423	837	198	7	619	725	199	4	290	608
Total	82	82	4192	4192	205	205	3502	3502	202	202	3108	3108

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