

Fecha de Publicación: 26 de Julio de 2011
Fecha de Información: 22 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\$1016,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,9%.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	61,3	152,4	81,4	3,4	51,0	37,9	20,0
15-35	278,6	300,6	93,0	116,0	115,6	70,6	92,0
36-60	25,4	3,1	0,0	0,0	3,1	25,4	0,0
61-90	35,7	46,6	35,0	0,0	11,6	35,7	0,0
91-180	0,0	55,5	10,0	0,0	45,5	0,0	0,0
>180	40,0	17,4	0,0	25,0	2,4	0,0	15,0
Total	441,0	575,6	219,4	144,4	229,2	169,6	127,0

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

* 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	70	2290	2431	8	198	2252	2249	4	199	1564	1989
Intragrupa y off-shore***	0	1	1558	1004	0	0	1033	776	0	0	1308	601
Otros	70	9	426	839	198	8	660	921	199	4	340	622
Total	81	81	4274	4274	206	206	3945	3945	202	202	3212	3212

* 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