

Fecha de Publicación: 28 de Julio de 2011
 Fecha de Información: 26 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\$1298,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,5%.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	163,9	140,6	130,0	90,0	4,6	67,9	6,0
15-35	333,4	295,5	142,0	141,5	20,9	59,2	132,7
36-60	18,8	12,6	0,0	0,0	12,6	18,8	0,0
61-90	77,9	86,9	0,0	20,0	81,9	52,9	5,0
91-180	52,5	50,3	0,0	50,0	50,3	2,5	0,0
>180	56,0	10,1	0,0	55,0	10,1	1,0	0,0
Total	702,4	596,0	272,0	356,5	180,3	202,3	143,7

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

* 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	25 al 29 de Julio				1 al 5 de Agosto				8 al 12 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	75	185	2371	2531	7	202	1707	2047	7	144	2073	2069
Intragrupa y off-shore***	0	0	1245	846	0	0	1333	711	0	0	946	774
Otros	185	75	709	947	202	7	367	650	144	7	522	699
Total	261	261	4325	4325	209	209	3408	3408	151	151	3542	3542

* 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