

Fecha de Publicación: 2 de Agosto de 2011
Fecha de Información: 29 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\$754,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.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	93,6	76,6	11,0	18,0	15,6	25,6	50,0
15-35	164,8	176,1	110,7	94,3	44,4	49,5	21,0
36-60	31,9	2,4	0,0	0,0	2,4	31,9	0,0
61-90	75,6	40,4	28,0	0,0	12,4	75,6	0,0
91-180	29,0	33,4	0,0	3,7	33,4	25,3	0,0
>180	6,3	24,7	0,0	5,0	24,7	1,3	0,0
Total	401,1	353,6	149,7	121,0	132,9	209,1	71,0

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

* 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**	74	141	2455	2607	7	216	1867	2249	8	146	2253	2186
Intragrupa y off-shore***	0	0	1260	889	0	0	1378	754	0	0	946	829
Otros	141	74	726	944	216	7	458	699	146	8	565	750
Total	215	215	4441	4441	222	222	3703	3703	154	154	3765	3765

* 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