

Fecha de Publicación: 7 de Julio de 2011
Fecha de Información: 05 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\$743,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.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	29,9	122,8	19,0	11,0	97,8	12,9	6,0
15-35	128,3	281,0	195,2	52,0	67,8	58,3	18,0
36-60	4,2	12,1	0,0	0,0	12,1	4,2	0,0
61-90	37,7	8,2	0,0	0,0	8,2	37,7	0,0
91-180	82,0	24,3	0,0	0,0	24,3	82,0	0,0
>180	10,0	2,5	0,0	10,0	2,5	0,0	0,0
Total	292,2	450,8	214,2	73,0	212,5	195,2	24,0

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

* 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	4 al 8 de Julio				11 al 15 de Julio				18 al 22 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	138	2123	2110	7	156	1976	2397	2	63	1784	1871
Intragrupa y off-shore***	14	0	1124	798	0	0	1574	768	0	0	1306	804
Otros	123	12	521	860	156	7	563	948	63	2	284	697
Total	149	149	3767	3767	163	163	4113	4113	65	65	3373	3373

* 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