

Fecha de Publicación: 8 de Julio de 2011
Fecha de Información: 06 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\$1611,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.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	58,9	250,5	69,4	6,0	150,2	21,9	31,0
15-35	459,8	465,6	267,0	210,4	24,6	75,4	174,0
36-60	51,8	14,7	0,0	0,0	4,7	41,8	10,0
61-90	31,4	47,9	20,0	0,0	7,9	11,4	20,0
91-180	40,9	90,4	75,0	0,0	15,4	40,9	0,0
>180	61,0	38,1	0,0	30,0	7,1	0,0	31,0
Total	703,7	907,2	431,4	246,4	209,9	191,4	266,0

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

* 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	116	2123	2166	7	159	2023	2537	2	63	1798	1957
Intragrupa y off-shore***	0	0	1160	798	0	0	1594	774	0	0	1344	804
Otros	116	12	541	860	159	7	651	958	63	2	331	712
Total	128	128	3824	3824	166	166	4269	4269	65	65	3473	3473

* 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