

Fecha de Publicación: 11 de Julio de 2011
Fecha de Información: 07 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\$1474,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	187,6	246,6	67,5	50,5	70,1	28,1	109,0
15-35	453,0	279,4	111,0	293,8	64,4	55,2	104,0
36-60	1,2	13,2	0,0	0,0	13,2	1,2	0,0
61-90	65,4	99,8	45,0	0,0	34,8	45,4	20,0
91-180	27,1	48,6	10,0	0,0	38,6	27,1	0,0
>180	13,0	39,4	5,9	13,0	33,6	0,0	0,0
Total	747,3	727,1	239,4	357,3	254,8	157,1	233,0

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

Sectores	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	99	2148	2211	7	174	2139	2630	3	64	1851	2059
Intragrupo y off-shore***	0	0	1176	798	0	0	1599	817	0	0	1391	811
Otros	99	12	546	860	174	7	681	971	64	3	361	733
Total	111	111	3869	3869	181	181	4419	4419	67	67	3603	3603

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo