

Fecha de Publicación: 25 de Julio de 2011
 Fecha de Información: 21 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\$1120,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	120,2	86,0	60,0	30,0	26,0	90,2	0,0
15-35	193,9	427,6	297,7	44,0	45,9	65,9	84,0
36-60	31,5	7,1	0,0	0,0	7,1	31,5	0,0
61-90	15,1	13,4	0,0	0,0	13,4	15,1	0,0
91-180	77,4	100,2	0,0	20,0	80,2	37,4	20,0
>180	28,3	19,5	0,0	20,0	19,5	8,3	0,0
Total	466,4	653,8	357,7	114,0	192,1	248,4	104,0

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

Sectores	18 al 22 de Julio				25 al 29 de Julio				1 al 5 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	74	2290	2431	7	198	2200	2128	4	199	1555	1959
Intragruppo y off-shore***	0	1	1558	1004	0	0	952	773	0	0	1308	601
Otros	74	9	426	839	197	7	641	892	199	4	310	613
Total	84	84	4274	4274	205	205	3793	3793	202	202	3173	3173

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo