

Fecha de Publicación: 29 de Julio de 2011
Fecha de Información: 27 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\$1324,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.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	178,0	159,0	0,0	58,0	84,0	45,0	75,0
15-35	388,9	297,0	187,0	153,3	12,0	137,7	98,0
36-60	33,1	4,2	0,0	0,0	4,2	33,1	0,0
61-90	28,7	44,6	0,0	0,0	44,6	28,7	0,0
91-180	42,2	52,6	5,0	0,0	47,6	42,2	0,0
>180	61,2	34,9	0,0	35,0	29,9	21,2	5,0
Total	732,1	592,4	192,0	246,3	222,4	307,8	178,0

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

* 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**	75	180	2449	2580	7	202	1782	2128	7	144	2150	2121
Intragrupa y off-shore***	0	0	1245	889	0	0	1333	726	0	0	946	804
Otros	180	75	723	948	202	7	412	672	144	7	551	722
Total	256	256	4417	4417	209	209	3527	3527	151	151	3647	3647

* 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