

Fecha de Publicación: 05 de Septiembre de 2011
 Fecha de Información: 01 de Septiembre 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\$1111,2 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	274,0	231,2	75,0	97,0	57,2	78,0	99,0
15-35	154,1	371,9	225,0	31,4	103,9	79,7	43,0
36-60	10,0	8,2	0,0	0,0	8,2	10,0	0,0
61-90	41,1	42,8	0,0	0,0	42,8	41,1	0,0
91-180	39,5	30,8	15,0	30,0	15,8	9,5	0,0
>180	48,0	29,5	0,0	20,0	1,5	0,0	28,0
Total	566,7	714,5	315,0	178,4	229,5	218,3	170,0

* 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	1,5 %	2,0 %	0,4 %	1,2 %
15-35	1,8 %	2,1 %	2,0 %	2,0 %
36-60	-	3,0 %	2,0 %	2,4 %
61-90	-	1,7 %	2,1 %	1,9 %
91-180	-	2,6 %	1,8 %	2,2 %
>180	1,8 %	2,6 %	1,7 %	1,8 %
Total	1,6 %	2,1 %	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	29 de Ago. al 2 de Septiembre				5 al 9 de Septiembre				12 al 16 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	163	2753	2731	9	110	2967	3219	13	99	2124	1993
Intragrupa y off-shore***	0	0	1492	1208	0	0	1670	1110	0	0	1061	593
Otros	163	12	656	962	110	9	737	1046	99	13	536	1135
Total	175	175	4901	4901	119	119	5374	5374	112	112	3721	3721

* 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 El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.