

Fecha de Publicación: 06 de Septiembre de 2011
 Fecha de Información: 02 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\$1101,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,9%.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	322,3	268,0	104,5	164,5	73,5	67,8	90,0
15-35	121,4	237,4	213,0	27,0	4,4	74,4	20,0
36-60	14,5	4,9	0,0	0,0	4,9	14,5	0,0
61-90	21,2	13,5	0,0	0,0	13,5	21,2	0,0
91-180	61,4	57,5	0,0	20,0	57,5	41,4	0,0
>180	12,4	77,2	5,0	5,0	72,2	7,4	0,0
Total	553,2	658,5	322,5	216,5	226,0	226,7	110,0

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

* 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

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	123	2725	2744	14	159	3170	3345	25	101	2224	2094
Intragrupa y off-shore***	0	0	1492	1208	0	0	1700	1214	0	0	1136	653
Otros	123	12	669	934	159	14	744	1054	101	25	561	1174
Total	135	135	4886	4886	173	173	5614	5614	126	126	3921	3921

* 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.