

Fecha de Publicación: 07 de Septiembre de 2011
Fecha de Información: 05 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\$152,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,0%.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	34,6	5,9	5,9	28,4	0,0	6,2	0,0
15-35	38,7	28,6	22,5	17,9	2,1	16,9	4,0
36-60	1,8	2,3	0,0	0,0	2,3	1,8	0,0
61-90	1,6	1,9	0,0	0,0	1,9	1,6	0,0
91-180	10,1	21,9	0,0	0,0	21,9	10,1	0,0
>180	3,8	4,8	0,0	0,0	4,8	3,8	0,0
Total	90,6	65,4	28,4	46,3	33,0	40,3	4,0

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

*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	5 al 9 de Septiembre				12 al 16 de Septiembre				19 al 23 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	155	3197	3344	27	101	2229	2099	9	94	1967	2088
Intragrupa y off-shore***	0	0	1701	1241	0	1	1141	653	0	0	1280	610
Otros	155	13	742	1054	101	26	562	1180	94	9	279	828
Total	167	167	5639	5639	128	128	3932	3932	103	103	3526	3526

* 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.