

Fecha de Publicación: 8 de Septiembre de 2011
 Fecha de Información: 06 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\$890,7 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	161,6	169,1	65,0	40,0	35,1	52,6	69,0
15-35	220,2	236,1	125,0	19,0	46,1	136,2	65,0
36-60	65,0	10,6	2,5	0,0	8,1	65,0	0,0
61-90	6,7	27,9	0,0	0,0	27,9	6,7	0,0
91-180	50,4	51,0	0,0	10,0	51,0	40,4	0,0
>180	17,9	23,3	0,0	0,0	8,3	2,9	15,0
Total	521,8	517,9	192,5	69,0	176,4	303,8	149,0

* 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	1,0 %	2,4 %	0,6 %	1,2 %
15-35	2,3 %	2,5 %	1,8 %	2,1 %
36-60	-	2,6 %	1,9 %	2,0 %
61-90	-	2,3 %	2,0 %	2,3 %
91-180	-	2,1 %	2,1 %	2,1 %
>180	1,7 %	2,2 %	1,8 %	1,9 %
Total	1,6 %	2,4 %	1,5 %	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	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**	20	150	3291	3392	32	101	2277	2224	10	94	1974	2088
Intragrupa y off-shore***	0	0	1701	1276	0	1	1206	653	0	0	1280	615
Otros	150	20	746	1069	101	31	597	1203	94	10	279	830
Total	170	170	5738	5738	133	133	4080	4080	104	104	3533	3533

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