

Fecha de Publicación: 09 de Septiembre de 2011
 Fecha de Información: 07 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\$1309,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,8%.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	374,6	140,4	27,6	250,6	37,8	49,0	75,0
15-35	214,6	455,1	357,0	66,5	4,1	54,1	94,0
36-60	121,3	8,2	0,0	0,0	3,2	116,3	5,0
61-90	53,0	26,6	0,0	10,5	16,6	32,5	10,0
91-180	0,4	40,9	3,0	0,0	37,9	0,4	0,0
>180	39,8	28,1	10,0	5,0	8,1	24,8	10,0
Total	803,7	699,3	397,6	332,6	107,7	277,1	194,0

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

* 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**	19	151	3489	3397	32	102	2427	2339	14	94	2028	2129
Intragrupa y off-shore***	0	0	1708	1457	0	1	1226	703	0	0	1320	665
Otros	151	19	728	1072	102	31	632	1243	94	14	280	835
Total	169	169	5925	5925	134	134	4285	4285	108	108	3628	3628

* 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.