

Fecha de Publicación: 12 de Septiembre de 2011
Fecha de Información: 08 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\$768,1 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	110,6	46,8	10,5	69,5	21,4	26,1	15,0
15-35	245,2	298,6	227,3	124,0	29,4	79,2	42,0
36-60	12,1	6,6	2,2	0,0	4,3	12,1	0,0
61-90	16,6	18,3	5,0	0,0	3,3	6,6	10,0
91-180	0,1	41,0	10,0	0,0	31,0	0,1	0,0
>180	15,0	39,1	0,0	0,0	24,1	0,0	15,0
Total	399,6	450,5	255,0	193,5	113,5	124,1	82,0

* 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	2,2 %	2,0 %	1,3 %	1,6 %
15-35	2,0 %	1,9 %	1,3 %	1,7 %
36-60	-	3,2 %	1,9 %	2,3 %
61-90	2,1 %	1,2 %	2,0 %	1,7 %
91-180	-	2,1 %	1,8 %	2,1 %
>180	1,9 %	2,2 %	-	2,1 %
Total	2,0 %	2,0 %	1,4 %	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	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	160	3499	3390	33	105	2485	2369	14	94	2089	2145
Intragrupa y off-shore***	0	0	1708	1466	5	1	1231	733	0	0	1320	714
Otros	160	19	721	1073	100	31	651	1265	94	14	286	837
Total	178	178	5929	5929	138	138	4367	4367	108	108	3696	3696

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.