

Fecha de Publicación: 13 de Septiembre de 2011
Fecha de Información: 09 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\$1205,2 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	221,6	245,7	114,8	61,0	70,9	100,6	60,0
15-35	234,0	371,8	304,5	85,5	7,6	88,8	59,7
36-60	46,7	1,2	0,0	0,0	1,2	46,7	0,0
61-90	18,2	11,5	10,0	0,0	1,5	18,2	0,0
91-180	76,4	35,9	0,0	30,0	5,9	16,4	30,0
>180	41,7	80,2	40,0	0,0	10,2	11,7	30,0
Total	638,5	746,4	469,3	176,5	97,4	282,3	179,7

* 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 %	2,3 %	0,3 %	0,8 %
15-35	2,7 %	2,5 %	2,0 %	2,4 %
36-60	-	3,0 %	2,0 %	2,0 %
61-90	-	1,3 %	2,0 %	1,8 %
91-180	2,0 %	2,5 %	2,0 %	2,1 %
>180	1,8 %	2,2 %	1,8 %	2,0 %
Total	0,8 %	2,4 %	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	151	3500	3390	34	101	2632	2490	15	97	2161	2277
Intragrupa y off-shore***	0	0	1708	1466	5	1	1316	793	0	0	1350	715
Otros	151	19	721	1073	96	33	668	1332	97	15	348	867
Total	170	170	5929	5929	136	136	4616	4616	112	112	3859	3859

* 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.