

Fecha de Publicación: 14 de Septiembre de 2011
Fecha de Información: 12 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\$1308,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	273,4	337,6	210,0	164,0	65,6	47,4	62,0
15-35	161,2	355,0	260,5	8,0	16,5	75,2	78,0
36-60	112,2	2,8	0,0	0,0	2,8	112,2	0,0
61-90	19,6	6,3	0,0	0,0	6,3	19,6	0,0
91-180	36,6	12,1	0,0	13,0	12,1	23,6	0,0
>180	122,9	8,5	5,0	65,0	3,5	57,9	0,0
Total	725,8	722,2	475,5	250,0	106,7	335,8	140,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,8 %	2,0 %	-1,3 %	1,0 %
15-35	2,0 %	3,1 %	2,6 %	2,7 %
36-60	-	2,9 %	2,3 %	2,3 %
61-90	-	2,8 %	2,1 %	2,3 %
91-180	-	2,7 %	1,7 %	2,1 %
>180	-	2,5 %	1,8 %	1,8 %
Total	2,4 %	2,5 %	1,0 %	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	12 al 16 de Septiembre				19 al 23 de Septiembre				26 al 30 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	91	172	4731	4771	35	196	3459	3998	25	770	3427	2981
Intragruppo y off-shore***	91	45	3529	2827	98	17	3011	1987	385	12	2067	2181
Otros	81	45	694	1356	98	17	387	873	385	12	470	803
Total	263	263	8953	8953	231	231	6858	6858	794	794	5965	5965

* 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 intragruppo.