

Fecha de Publicación: 16 de Septiembre de 2011
Fecha de Información: 14 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\$1499,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,1%.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	165,2	221,0	130,5	81,0	56,5	50,2	34,0
15-35	372,6	520,3	381,3	168,0	58,1	123,6	81,0
36-60	109,7	20,8	20,0	0,0	0,8	109,7	0,0
61-90	38,6	12,4	0,0	0,0	12,4	38,6	0,0
91-180	19,3	25,5	10,0	0,0	15,5	19,3	0,0
>180	43,7	65,5	63,0	0,0	2,5	43,7	0,0
Total	749,1	865,4	604,8	249,0	145,7	385,1	115,0

* 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	6,9 %	2,7 %	-0,6 %	1,9 %
15-35	2,5 %	2,4 %	1,8 %	2,2 %
36-60	-	3,3 %	2,5 %	2,5 %
61-90	-	3,9 %	2,8 %	3,1 %
91-180	-	1,5 %	1,9 %	1,7 %
>180	-	0,5 %	1,7 %	0,9 %
Total	3,8 %	2,2 %	1,5 %	2,1 %

* 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**	44	89	3057	2895	18	99	2334	2570	14	386	2195	1671
Intragrupa y off-shore***	5	1	1530	1010	0	0	1452	811	0	0	717	861
Otros	84	43	705	1387	99	18	475	881	385	14	485	866
Total	133	133	5292	5292	116	116	4261	4261	400	400	3398	3397

* 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.