

Fecha de Publicación: 19 de Septiembre de 2011
Fecha de Información: 15 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\$831,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	76,4	79,1	1,5	17,0	34,6	16,4	43,0
15-35	215,4	330,1	209,1	46,0	33,5	81,9	87,5
36-60	14,6	20,9	0,0	0,0	20,9	14,6	0,0
61-90	150,7	5,1	0,0	0,0	0,1	145,7	5,0
91-180	9,1	32,7	10,0	0,0	22,7	9,1	0,0
>180	14,0	18,6	10,0	0,0	8,6	14,0	0,0
Total	480,2	486,5	230,6	63,0	120,4	281,7	135,5

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

*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	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	3065	2903	18	94	2374	2664	14	385	2210	1698
Intragrupa y off-shore***	5	1	1530	1010	0	0	1490	828	0	0	717	861
Otros	84	43	706	1388	94	18	502	874	385	14	505	873
Total	133	133	5301	5301	112	112	4366	4366	400	400	3432	3432

* 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.