

Fecha de Publicación: 17 de Septiembre de 2011
Fecha de Información: 16 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\$1354,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.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	312,7	202,2	106,0	243,0	36,2	9,7	60,0
15-35	264,2	247,5	145,0	145,5	22,5	38,7	80,0
36-60	25,0	24,5	0,0	0,0	24,5	25,0	0,0
61-90	79,9	121,7	120,0	4,5	1,7	75,4	0,0
91-180	72,2	38,7	29,5	1,8	9,2	70,5	0,0
>180	47,7	93,0	41,0	2,4	17,0	10,3	35,0
Total	801,7	727,6	441,5	397,2	111,1	229,6	175,0

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

* 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	88	3065	2903	18	100	2625	2816	15	385	2271	1745
Intragrupa y off-shore***	5	1	1530	1010	0	0	1569	1036	0	0	744	896
Otros	83	42	706	1388	100	18	535	878	385	15	505	879
Total	132	132	5301	5301	117	117	4729	4729	400	400	3520	3520

* 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.