

Fecha de Publicación: 22 de Septiembre de 2011
 Fecha de Información: 20 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\$1548,8 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	209,6	267,7	78,0	51,0	82,7	51,6	107,0
15-35	499,5	570,4	359,1	199,0	60,3	149,5	151,0
36-60	6,3	30,7	20,0	0,0	10,7	6,3	0,0
61-90	77,3	3,3	0,0	0,0	3,3	77,3	0,0
91-180	18,4	36,2	30,0	0,0	6,2	18,4	0,0
>180	30,8	56,4	43,0	3,2	13,4	27,6	0,0
Total	842,0	964,8	530,1	253,2	176,6	330,8	258,0

* 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 %	2,5 %	1,9 %	1,9 %
15-35	2,0 %	3,6 %	3,2 %	3,2 %
36-60	-	4,0 %	1,5 %	3,4 %
61-90	-	3,4 %	2,7 %	2,7 %
91-180	-	2,7 %	2,3 %	2,6 %
>180	-	2,3 %	2,1 %	2,2 %
Total	1,7 %	3,2 %	2,8 %	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	19 al 23 de Septiembre				26 al 30 de Septiembre				3 al 7 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	92	2837	2888	16	380	2395	2112	10	114	2070	2142
Intragrupa y off-shore***	0	0	1575	1190	0	0	899	896	0	0	1288	335
Otros	92	18	578	912	380	16	629	915	114	10	246	1102
Total	110	110	4990	4990	395	395	3923	3923	124	124	3604	3579

* 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 intragrupo.