

Fecha de Publicación: 23 de Septiembre de 2011
Fecha de Información: 21 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\$1460,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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	242,4	255,9	192,0	138,0	19,9	60,4	44,0
15-35	414,0	430,1	316,6	167,5	27,5	160,5	86,0
36-60	2,4	8,1	0,0	0,0	8,1	2,4	0,0
61-90	11,5	19,6	5,5	0,0	14,1	11,5	0,0
91-180	33,5	11,9	0,0	1,7	11,9	31,8	0,0
>180	92,1	72,1	64,5	21,7	4,6	67,4	3,0
Total	795,8	797,7	578,6	328,9	86,1	333,9	133,0

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

* 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	86	3019	2951	16	380	2461	2301	11	114	2090	2164
Intragrupa y off-shore***	0	0	1610	1353	0	0	1055	896	0	0	1300	325
Otros	86	18	591	916	380	16	648	966	114	11	241	1116
Total	103	103	5220	5220	396	396	4163	4163	124	124	3631	3606

* 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.