

Fecha de Publicación: 29 de Septiembre de 2011
Fecha de Información: 27 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\$1316,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.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	197,5	112,2	73,0	159,5	17,2	16,0	22,0
15-35	529,9	281,7	133,8	314,5	50,2	117,8	97,7
36-60	56,7	9,2	0,0	5,0	9,2	51,7	0,0
61-90	31,1	69,6	5,0	0,0	44,6	11,1	20,0
91-180	22,4	16,9	2,0	15,0	9,9	2,4	5,0
>180	6,1	127,6	104,0	1,0	23,6	5,1	0,0
Total	843,7	617,2	317,8	495,0	154,7	204,1	144,7

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

* 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	26 al 30 de Septiembre				3 al 7 de Octubre				10 al 14 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	383	3194	2912	13	113	2325	2510	10	78	1667	2289
Intragrupa y off-shore***	0	0	1167	1227	0	0	1457	467	0	0	1509	677
Otros	383	15	842	1065	113	13	378	1158	78	10	343	553
Total	398	398	5204	5204	127	127	4160	4135	89	89	3519	3519

* 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.