

Fecha de Publicación: 30 de Septiembre de 2011
Fecha de Información: 28 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\$1632,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,4%.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	298,5	233,8	44,0	169,0	119,8	59,5	70,0
15-35	439,8	364,1	223,0	288,3	29,1	39,6	112,0
36-60	42,4	55,7	25,0	0,0	30,7	42,4	0,0
61-90	140,0	14,1	10,0	10,0	4,1	130,0	0,0
91-180	15,0	12,0	0,0	0,0	12,0	15,0	0,0
>180	26,4	172,5	172,4	0,0	0,1	26,4	0,0
Total	962,2	852,2	474,4	467,3	195,9	312,9	182,0

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

* 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	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	410	3381	3028	15	112	2458	2641	11	78	1775	2394
Intragrupa y off-shore***	0	0	1259	1366	0	0	1457	497	0	0	1509	707
Otros	410	15	812	1058	112	15	469	1221	78	11	373	556
Total	425	425	5452	5452	127	127	4384	4359	89	89	3657	3657

* 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.