

Fecha de Publicación: 03 de Octubre de 2011
 Fecha de Información: 29 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\$1516,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,5%.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	377,6	197,1	33,0	254,0	95,1	54,6	69,0
15-35	264,6	354,6	270,8	211,0	73,8	43,6	10,0
36-60	11,9	14,4	12,0	0,0	2,4	11,9	0,0
61-90	43,7	55,6	0,0	36,5	55,6	7,1	0,0
91-180	33,9	41,0	10,0	0,2	31,0	33,7	0,0
>180	21,7	179,6	175,7	0,9	3,8	20,7	0,0
Total	753,3	842,2	501,5	502,7	261,7	171,6	79,0

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

* 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	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**	18	435	3457	3011	15	112	2700	2790	11	78	1844	2437
Intragrupa y off-shore***	0	0	1263	1446	0	0	1486	641	0	0	1509	737
Otros	435	18	791	1054	112	15	540	1270	78	11	396	575
Total	454	454	5511	5511	127	127	4726	4701	89	89	3750	3749

* 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.