

Fecha de Publicación: 4 de Octubre de 2011
Fecha de Información: 30 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\$1072,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,8%.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	166,0	145,3	106,5	122,8	20,8	25,2	18,0
15-35	196,2	335,2	271,5	153,0	27,7	7,2	36,0
36-60	45,2	5,4	0,0	0,0	5,4	45,2	0,0
61-90	12,4	47,1	45,0	0,0	2,1	12,4	0,0
91-180	24,7	50,0	20,0	0,0	30,0	24,7	0,0
>180	33,9	67,6	65,0	0,0	0,1	31,4	2,5
Total	478,3	650,5	508,0	275,8	86,0	146,0	56,5

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

* 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	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	422	3457	3013	14	107	2820	2863	14	79	1879	2514
Intragrupa y off-shore***	0	0	1263	1446	0	0	1531	731	0	0	1570	760
Otros	421	18	793	1054	107	14	559	1292	79	14	403	577
Total	440	440	5512	5512	121	121	4910	4885	93	93	3851	3851

* 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.