

Fecha de Publicación: 06 de Octubre de 2011
Fecha de Información: 04 de Octubre 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\$951,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	260,6	183,8	30,1	158,2	113,8	62,4	40,0
15-35	114,0	235,3	180,5	68,1	34,8	25,9	20,0
36-60	42,1	44,2	27,5	0,2	5,7	30,9	11,0
61-90	12,1	16,9	13,0	0,2	3,9	11,9	0,0
91-180	28,3	18,4	10,0	0,7	8,4	27,7	0,0
>180	50,9	21,1	10,0	1,5	6,1	44,4	5,0
Total	508,1	519,7	271,1	228,9	172,6	203,2	76,0

* 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	2,1 %	3,0 %	2,3 %	2,5 %
15-35	2,8 %	2,8 %	1,6 %	2,5 %
36-60	2,6 %	2,6 %	1,6 %	2,1 %
61-90	-	3,2 %	2,1 %	2,8 %
91-180	-	2,9 %	12,1 %	9,6 %
>180	2,6 %	2,7 %	10,7 %	9,1 %
Total	2,4 %	2,9 %	3,5 %	3,1 %

* 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	3 al 7 de Octubre				10 al 14 de Octubre				17 al 21 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	101	3392	3242	19	80	2029	2522	10	90	1950	2034
Intragrupa y off-shore***	0	0	1678	1077	0	1	1531	875	0	0	1268	654
Otros	101	22	674	1399	80	17	452	615	90	10	405	936
Total	123	123	5743	5718	98	98	4012	4012	100	100	3623	3623

* 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.