

Fecha de Publicación: 10 de Octubre de 2011
Fecha de Información: 06 de Octubre de 2011¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1323,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,2%.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	348,0	76,7	30,0	270,0	32,7	64,0	14,0
15-35	387,4	283,1	174,0	277,8	65,1	65,6	44,0
36-60	5,1	20,7	7,5	0,0	13,2	5,1	0,0
61-90	11,5	73,8	10,0	0,0	55,8	3,5	8,0
91-180	11,9	56,3	51,5	0,0	4,8	11,9	0,0
>180	14,1	100,6	80,0	5,0	20,6	9,1	0,0
Total	777,9	611,3	353,0	552,8	192,3	159,1	66,0

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

* 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	103	3862	3457	22	82	2316	2650	11	86	2028	2066
Intragrupa y off-shore***	0	0	1794	1468	0	1	1477	979	0	0	1273	687
Otros	103	22	706	1411	82	21	525	689	86	11	426	974
Total	124	124	6362	6337	104	104	4318	4318	97	97	3727	3727

* 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.