

Fecha de Publicación: 12 de Octubre de 2011
Fecha de Información: 10 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\$185,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,6%.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	67,8	73,8	0,0	0,2	13,8	7,7	60,0
15-35	24,0	25,5	10,0	13,0	10,5	6,0	5,0
36-60	24,8	26,0	0,0	0,0	6,0	4,8	20,0
61-90	0,4	1,1	0,0	0,0	1,1	0,4	0,0
91-180	9,3	5,3	0,0	0,0	5,3	9,3	0,0
>180	3,7	9,2	0,2	0,0	9,0	3,7	0,0
Total	130,0	140,9	10,2	13,2	45,7	31,8	85,0

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

* 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	10 al 14 de Octubre				17 al 21 de Octubre				24 al 28 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	75	2433	2804	12	92	2150	2151	11	121	2550	2125
Intragrupa y off-shore***	0	1	1512	979	0	0	1273	752	0	0	1215	1082
Otros	75	24	578	739	92	12	471	991	121	11	461	1019
Total	100	100	4523	4523	105	105	3893	3893	131	131	4226	4226

* 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.