

Fecha de Publicación: 13 de Octubre de 2011
Fecha de Información: 11 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\$1382,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	210,8	188,3	74,0	154,0	73,3	15,8	41,0
15-35	184,9	275,8	224,5	91,0	19,8	62,4	31,5
36-60	32,0	112,9	92,5	6,4	20,4	25,6	0,0
61-90	0,4	221,9	217,0	0,0	4,9	0,4	0,0
91-180	118,3	46,1	35,0	0,0	11,1	118,3	0,0
>180	10,7	52,8	40,0	5,4	12,8	5,3	0,0
Total	557,1	897,8	683,0	256,8	142,3	227,8	72,5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,9 %	2,7 %	0,9 %	1,9 %
15-35	1,8 %	1,8 %	1,1 %	1,5 %
36-60	-	2,4 %	1,5 %	1,8 %
61-90	-	2,3 %	1,7 %	2,3 %
91-180	-	1,7 %	1,8 %	1,8 %
>180	-	2,0 %	1,8 %	1,9 %
Total	2,5 %	2,0 %	1,3 %	1,7 %

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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 intragruppo.

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**	31	70	2559	2888	13	92	2201	2258	11	121	2587	2172
Intragruppo y off-shore***	0	1	1545	1063	0	0	1314	797	0	0	1245	1107
Otros	70	30	589	742	92	13	534	995	121	11	472	1026
Total	101	101	4693	4693	105	105	4049	4049	132	132	4305	4305

* 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.