

Fecha de Publicación: 14 de Octubre de 2011
Fecha de Información: 12 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\$1300,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,4%.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	270,6	147,8	25,0	155,0	59,8	52,5	63,0
15-35	312,7	264,8	201,1	219,0	45,7	75,7	18,0
36-60	43,1	55,6	20,0	0,0	30,6	38,1	5,0
61-90	25,4	21,1	15,0	20,0	6,1	5,4	0,0
91-180	57,6	18,6	0,0	0,0	18,6	57,6	0,0
>180	8,0	161,2	125,0	5,0	36,2	3,0	0,0
Total	717,3	669,1	386,1	399,0	197,0	232,2	86,0

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

* 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**	32	68	2759	2996	15	95	2234	2288	11	123	2644	2180
Intragrupa y off-shore***	0	1	1570	1190	0	0	1314	812	0	0	1245	1140
Otros	68	31	629	772	95	15	544	993	123	11	480	1050
Total	100	100	4958	4958	109	109	4092	4092	134	134	4370	4370

* 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.