

Fecha de Publicación: 18 de Octubre de 2011
Fecha de Información: 13 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\$1718,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,4%.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	399,2	225,9	77,0	258,5	64,9	56,7	84,0
15-35	391,5	511,4	360,7	263,0	86,7	64,5	64,0
36-60	25,2	4,4	0,0	0,0	4,4	25,2	0,0
61-90	51,4	49,4	0,0	10,0	19,4	11,4	30,0
91-180	67,7	56,9	20,0	0,0	16,9	47,7	20,0
>180	8,9	124,6	122,0	0,0	2,6	8,9	0,0
Total	943,9	972,7	579,7	531,5	195,0	214,4	198,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,7 %	1,7 %	0,9 %	1,2 %
15-35	1,9 %	1,6 %	1,0 %	1,4 %
36-60	-	1,9 %	1,5 %	1,6 %
61-90	1,9 %	2,6 %	1,7 %	2,0 %
91-180	1,2 %	1,8 %	1,7 %	1,6 %
>180	-	1,6 %	1,0 %	1,6 %
Total	1,7 %	1,7 %	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	66	2904	3001	17	95	2473	2437	11	123	2666	2263
Intragruppo y off-shore***	0	1	1573	1330	0	0	1353	920	0	0	1285	1150
Otros	66	30	626	772	95	17	575	1044	123	11	524	1062
Total	97	97	5103	5103	113	113	4401	4401	134	134	4475	4475

* 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 intragruppo.