

Fecha de Publicación: 21 de Octubre de 2011
Fecha de Información: 19 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\$1450,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,3%.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	332,1	202,1	133,0	286,0	37,1	14,1	32,0
15-35	458,8	539,9	325,0	203,0	38,9	79,8	176,0
36-60	23,1	10,0	7,5	0,0	2,5	23,1	0,0
61-90	2,9	4,4	0,0	0,0	4,4	2,9	0,0
91-180	31,8	41,1	20,0	0,0	1,1	11,8	20,0
>180	32,1	0,0	0,0	25,0	0,0	7,1	0,0
Total	880,8	797,6	485,5	514,0	84,1	138,8	228,0

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

* 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	17 al 21 de Octubre				24 al 28 de Octubre				31 de Oct. al 4 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	97	3073	2662	11	125	2859	2471	8	86	2188	1837
Intragrupa y off-shore***	0	0	1554	1455	0	0	1432	1311	0	0	1238	982
Otros	97	18	596	1107	124	11	562	1072	86	8	295	902
Total	115	115	5223	5223	136	136	4853	4853	94	94	3721	3721

* 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.