

Fecha de Publicación: 24 de Octubre de 2011
Fecha de Información: 20 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\$1083,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,2%.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	111,1	78,5	30,5	45,0	19,7	37,8	28,3
15-35	351,5	440,0	278,5	139,3	33,8	84,4	127,8
36-60	11,6	9,0	0,0	0,0	9,0	11,6	0,0
61-90	20,1	12,4	0,0	20,0	12,4	0,1	0,0
91-180	98,5	60,0	55,0	0,0	5,0	98,5	0,0
>180	31,4	35,1	15,0	2,5	0,1	8,9	20,0
Total	624,2	634,9	379,0	206,8	80,0	241,4	176,0

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

* 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**	17	108	3079	2648	12	125	2948	2543	8	86	2209	1837
Intragrupa y off-shore***	0	0	1560	1460	0	0	1457	1351	0	0	1238	982
Otros	108	17	577	1107	125	12	581	1092	86	8	295	923
Total	125	125	5215	5215	136	136	4986	4986	94	94	3743	3743

* 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.