

Fecha de Publicación: 25 de Octubre de 2011
Fecha de Información: 21 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\$1480,1 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	210,8	242,8	159,4	163,8	49,4	13,0	34,0
15-35	363,9	238,8	107,0	243,5	34,8	23,4	97,0
36-60	29,4	46,7	17,5	20,0	29,2	9,4	0,0
61-90	15,2	47,0	20,0	5,0	27,0	10,2	0,0
91-180	128,3	132,5	60,0	0,0	62,5	118,3	10,0
>180	25,0	165,8	95,8	0,0	45,0	0,0	25,0
Total	772,6	873,5	459,7	432,3	247,8	174,3	166,0

* Cifras en millones de dólares

** Incluye operaciones interbancarias y operaciones 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 %	0,8 %	0,8 %	0,8 %
15-35	1,5 %	1,8 %	1,0 %	1,3 %
36-60	-	2,3 %	1,0 %	1,6 %
61-90	-	2,0 %	1,4 %	1,9 %
91-180	1,5 %	1,8 %	1,3 %	1,5 %
>180	1,4 %	1,6 %	-	1,6 %
Total	1,4 %	1,5 %	1,0 %	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**	17	108	3079	2682	13	118	3089	2731	8	87	2278	1893
Intragrupa y off-shore***	0	0	1560	1460	0	0	1566	1450	0	0	1288	1047
Otros	108	17	610	1107	118	13	625	1100	87	8	301	927
Total	125	125	5249	5249	131	131	5280	5280	96	96	3867	3867

* 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.