

Fecha de Publicación: 28 de Septiembre de 2011
 Fecha de Información: 26 de Septiembre de 2011 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS (Información Revisada)

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1205,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.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	421,4	483,6	71,5	153,5	153,6	9,4	258,5
15-35	369,9	193,6	42,0	119,0	3,6	102,9	148,0
36-60	2,3	0,2	0,0	0,0	0,2	2,3	0,0
61-90	7,3	1,0	0,0	0,0	1,0	7,3	0,0
91-180	25,6	5,9	0,0	0,2	5,9	25,4	0,0
>180	22,2	89,1	75,0	0,4	4,1	11,8	10,0
Total	848,8	773,3	188,5	273,1	168,3	159,2	416,5

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

* 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	26 al 30 de Septiembre				3 al 7 de Octubre				10 al 14 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	379	3023	2813	12	113	2265	2471	10	78	1681	2305
Intragrupa y off-shore***	0	0	1133	1112	0	0	1412	412	0	0	1507	677
Otros	379	17	833	1065	113	12	375	1144	78	10	343	549
Total	396	396	4990	4990	126	126	4052	4027	88	88	3531	3531

* 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.