

Fecha de Publicación: 08 de Noviembre de 2011
 Fecha de Información: 03 de Noviembre 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\$1656,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,2%.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	365,4	249,7	127,5	190,0	36,2	89,4	86,0
15-35	467,3	411,6	153,5	183,0	39,1	65,3	219,0
36-60	155,8	232,7	101,0	45,0	51,7	30,8	80,0
61-90	30,5	15,7	10,0	25,0	5,7	5,5	0,0
91-180	85,2	33,2	0,0	5,0	3,2	50,2	30,0
>180	16,5	15,5	0,0	5,0	7,5	3,5	8,0
Total	1120,8	958,5	392,0	453,0	143,5	244,8	423,0

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

* 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	31 de Oct. al 4 de Noviembre				7 al 11 de Noviembre				14 al 18 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	94	3141	2348	19	128	2218	1902	43	172	2468	2246
Intragrupa y off-shore***	0	0	1484	1580	0	1	1189	1101	0	0	1400	990
Otros	94	14	391	1088	128	17	313	718	172	43	315	948
Total	107	107	5016	5016	147	147	3721	3721	215	215	4184	4184

* 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.