

Fecha de Publicación: 16 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 11 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\$363,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.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	72,8	79,7	38,4	21,4	1,3	11,4	40,0
15-35	142,6	129,5	50,0	64,0	7,5	6,6	72,0
36-60	2,3	13,2	1,5	0,0	11,7	2,3	0,0
61-90	5,3	16,7	3,0	0,0	13,7	5,3	0,0
91-180	1,4	10,1	0,0	0,0	10,1	1,4	0,0
>180	0,4	1,1	0,0	0,0	1,1	0,4	0,0
Total	224,8	250,2	92,9	85,4	45,3	27,4	112,0

* 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	0,4 %	0,8 %	0,5 %	0,5 %
15-35	0,7 %	1,4 %	0,3 %	0,7 %
36-60	-	1,7 %	0,0 %	1,4 %
61-90	-	1,5 %	0,2 %	1,2 %
91-180	-	0,9 %	0,1 %	0,8 %
>180	-	1,8 %	0,0 %	1,4 %
Total	0,6 %	1,2 %	0,4 %	0,8 %

* 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	7 al 11 de Noviembre				14 al 18 de Noviembre				21 al 25 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	102	2383	2251	165	168	2804	2593	13	153	2419	2418
Intragrupa y off-shore***	0	1	1482	1190	0	0	1620	1174	0	0	1324	988
Otros	102	18	309	733	168	165	374	1032	153	13	351	688
Total	121	121	4174	4174	334	334	4798	4798	166	166	4094	4094

* 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.