

Fecha de Publicación: 23 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 21 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\$897,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.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	122,6	144,5	98,5	56,5	31,0	51,1	15,0
15-35	157,2	294,4	170,0	44,0	27,5	16,2	97,0
36-60	34,9	102,4	64,6	0,0	37,8	34,9	0,0
61-90	31,0	4,9	0,0	0,0	4,9	31,0	0,0
91-180	50,2	61,5	50,0	40,0	11,5	10,2	0,0
>180	5,0	1,3	1,0	0,0	0,3	5,0	0,0
Total	400,9	608,9	384,1	140,5	112,9	148,4	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	3,6 %	3,0 %	0,7 %	1,9 %
15-35	3,8 %	3,7 %	3,4 %	3,7 %
36-60	-	2,3 %	2,0 %	2,2 %
61-90	-	2,1 %	1,9 %	1,9 %
91-180	-	0,4 %	2,0 %	1,1 %
>180	-	1,8 %	1,1 %	1,3 %
Total	3,7 %	2,8 %	1,8 %	2,6 %

*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	21 al 25 de Noviembre				28 de Nov. al 2 de Diciembre				5 al 9 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	161	2692	3017	11	196	2308	2184	5	386	1551	1909
Intragrupa y off-shore***	0	0	1627	1153	0	0	1172	1079	0	0	913	559
Otros	161	36	586	735	196	11	465	682	386	5	315	311
Total	196	196	4906	4906	207	207	3945	3945	391	391	2778	2778

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.