

Fecha de Publicación: 24 de Noviembre de 2011
 Fecha de Información: 22 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\$1089,9 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	138,0	109,2	86,3	65,0	12,9	63,0	10,0
15-35	296,1	291,5	171,5	185,8	14,0	4,3	106,0
36-60	1,4	14,4	0,3	0,0	14,1	1,4	0,0
61-90	61,3	147,8	60,0	8,0	57,8	23,3	30,0
91-180	40,0	131,7	86,1	0,0	5,6	0,0	40,0
>180	34,4	30,0	5,0	10,0	5,0	4,4	20,0
Total	571,3	724,6	409,1	268,8	109,5	96,5	206,0

* 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	4,0 %	3,2 %	2,1 %	2,7 %
15-35	3,0 %	3,2 %	2,7 %	3,0 %
36-60	-	2,7 %	2,3 %	2,7 %
61-90	2,5 %	2,3 %	1,9 %	2,3 %
91-180	1,9 %	2,0 %	0,3 %	2,0 %
>180	1,5 %	1,6 %	1,6 %	1,5 %
Total	2,6 %	2,8 %	2,4 %	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	155	2730	3102	14	197	2362	2213	5	387	1623	1991
Intragrupa y off-shore***	0	0	1685	1173	0	0	1197	1079	0	0	967	604
Otros	155	36	607	748	197	14	468	736	387	5	317	312
Total	191	191	5023	5023	210	210	4028	4028	391	391	2907	2907

* 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.