

Fecha de Publicación: 29 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 25 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\$865,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	146,5	114,8	19,0	92,4	53,8	12,1	42,0
15-35	225,6	109,3	53,9	145,0	12,4	37,6	43,0
36-60	18,2	51,1	35,3	0,0	15,8	18,2	0,0
61-90	45,7	112,0	85,0	0,0	12,0	30,7	15,0
91-180	39,2	66,5	22,9	0,0	43,6	39,2	0,0
>180	22,4	14,2	10,0	12,0	4,1	10,4	0,0
Total	497,6	467,8	226,1	249,4	141,7	148,2	100,1

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

* 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**	35	152	2921	3191	16	191	2540	2375	5	540	1999	2429
Intragrupa y off-shore***	0	0	1754	1354	0	0	1261	1183	0	0	1229	679
Otros	152	35	611	741	191	16	499	742	540	5	317	438
Total	188	188	5286	5286	208	208	4300	4300	545	545	3546	3546

* 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.