

Fecha de Publicación: 1 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 28 de Octubre 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\$1047,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,5%.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	227,1	184,5	77,6	80,5	9,4	49,1	97,5
15-35	289,7	271,7	108,1	158,5	43,6	11,2	120,0
36-60	29,4	137,3	20,0	0,0	93,3	5,4	24,0
61-90	55,5	15,3	10,0	43,0	5,3	12,5	0,0
91-180	22,1	33,6	0,0	0,0	25,6	14,1	8,0
>180	27,8	3,2	0,0	0,0	3,2	27,8	0,0
Total	651,7	645,6	215,7	282,0	180,4	120,2	249,5

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

* 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	24 al 28 de Octubre				31 de Oct. al 4 de Noviembre				7 al 11 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	53	71	3528	3027	11	92	2819	2218	11	131	1925	1640
Intragrupa y off-shore***	0	0	1732	1740	0	0	1421	1336	0	0	1085	1000
Otros	71	53	651	1143	92	11	365	1050	131	11	251	621
Total	125	125	5910	5910	103	103	4605	4605	142	142	3261	3261

* 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.