

Fecha de Publicación: 2 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 31 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\$738,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,7%.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	113,6	56,1	12,0	82,0	19,1	6,6	25,0
15-35	185,9	248,2	108,5	73,5	38,7	11,4	101,0
36-60	8,3	6,1	0,0	0,0	6,1	8,3	0,0
61-90	28,5	20,6	0,0	0,0	5,6	13,5	15,0
91-180	179,2	65,9	15,0	20,0	5,9	114,2	45,0
>180	10,0	6,7	0,0	5,0	1,7	0,0	5,0
Total	525,5	403,7	135,5	180,5	77,2	154,0	191,0

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

* 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	31 de Oct. al 4 de Noviembre				7 al 11 de Noviembre				14 al 18 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	102	2883	2230	12	122	1983	1680	9	166	2194	2133
Intragrupa y off-shore***	0	0	1433	1387	0	0	1085	1031	0	0	1352	831
Otros	102	10	365	1063	122	12	266	623	166	9	302	885
Total	113	113	4680	4680	134	134	3334	3334	175	175	3848	3848

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.