

Fecha de Publicación: 03 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 01 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\$1072,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.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	191,2	138,0	53,0	57,3	45,9	94,9	39,0
15-35	232,6	220,7	133,7	167,6	44,0	22,1	43,0
36-60	35,2	75,1	0,0	30,0	74,6	4,7	0,5
61-90	54,0	25,2	20,0	0,0	5,2	54,0	0,0
91-180	13,1	60,2	55,0	0,0	2,2	10,1	3,1
>180	44,7	88,2	55,0	0,0	13,2	24,7	20,0
Total	570,9	607,3	316,7	254,9	185,0	210,4	105,6

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

* 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	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**	14	100	2961	2287	17	125	2076	1757	14	168	2213	2154
Intragrupa y off-shore***	0	0	1466	1438	0	1	1105	1031	0	0	1359	836
Otros	100	14	385	1087	125	15	287	680	168	14	306	888
Total	114	114	4812	4812	142	142	3468	3468	182	182	3878	3878

* 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.