

Fecha de Publicación: 09 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 04 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\$1202,7 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	230,5	126,3	80,5	107,5	22,8	100,0	23,0
15-35	199,5	340,8	270,2	81,8	32,8	80,0	37,8
36-60	60,9	120,1	9,7	0,0	50,4	0,9	60,0
61-90	58,7	57,9	0,1	10,8	12,7	2,9	45,0
91-180	103,3	29,9	10,0	15,0	14,8	83,2	5,1
>180	40,0	29,3	5,8	5,0	0,1	11,5	23,5
Total	692,9	704,2	376,3	220,0	133,6	278,4	194,4

* 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	1,6 %	0,2 %	-12,0 %	-7,7 %
15-35	0,1 %	0,2 %	0,0 %	0,1 %
36-60	0,2 %	-17,5 %	-0,9 %	-8,6 %
61-90	-0,1 %	0,9 %	-0,1 %	0,1 %
91-180	0,1 %	1,3 %	0,0 %	0,2 %
>180	0,5 %	1,1 %	0,5 %	0,6 %
Total	0,3 %	-1,9 %	-5,0 %	-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	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**	13	83	3141	2348	20	115	2334	1990	74	175	2552	2282
Intragrupa y off-shore***	0	0	1484	1580	0	1	1249	1188	0	0	1420	1010
Otros	83	13	392	1088	115	19	321	726	175	74	328	1009
Total	95	95	5017	5017	135	135	3904	3904	249	249	4301	4301

* 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.