

Fecha de Publicación: 10 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 08 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\$912,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,2%.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	197,3	228,4	131,5	70,3	7,0	37,1	90,0
15-35	173,2	238,7	129,8	145,3	88,9	7,9	20,0
36-60	22,5	64,7	42,2	20,0	22,5	2,5	0,0
61-90	35,4	2,4	0,0	0,0	2,4	35,4	0,0
91-180	30,5	23,7	20,0	0,0	3,7	30,5	0,0
>180	3,5	2,2	0,0	0,0	2,2	3,5	0,0
Total	462,5	560,2	323,5	235,6	126,7	116,9	110,0

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

* 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	7 al 11 de Noviembre				14 al 18 de Noviembre				21 al 25 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	104	2378	2153	102	176	2653	2337	12	158	2297	2217
Intragrupa y off-shore***	0	1	1381	1190	0	0	1420	1059	0	0	1256	971
Otros	104	19	313	728	176	102	334	1011	158	12	300	665
Total	124	124	4071	4071	277	277	4407	4407	171	171	3853	3853

* 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.