

Fecha de Publicación: 17 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 15 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\$1174,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	81,8	186,8	145,4	50,0	20,4	10,8	21,0
15-35	401,2	302,2	169,2	289,0	34,9	14,2	98,0
36-60	111,0	30,8	2,0	0,0	6,8	89,0	22,0
61-90	7,1	12,5	0,9	0,0	11,6	7,1	0,0
91-180	116,9	27,6	20,0	65,4	7,6	51,5	0,0
>180	34,1	8,7	0,0	20,0	3,7	9,1	5,0
Total	752,2	568,5	337,5	424,4	85,0	181,8	146,0

* 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	1,5 %	-0,4 %	9,0 %	1,5 %
15-35	1,2 %	0,9 %	0,8 %	0,9 %
36-60	0,3 %	1,7 %	0,4 %	0,4 %
61-90	-	1,1 %	0,5 %	0,9 %
91-180	-	0,6 %	0,2 %	0,3 %
>180	0,8 %	2,7 %	0,3 %	0,7 %
Total	1,1 %	0,4 %	1,2 %	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	14 al 18 de Noviembre				21 al 25 de Noviembre				28 de Nov. al 2 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	168	151	2836	2697	26	162	2435	2442	11	194	2107	1819
Intragrupo y off-shore***	0	0	1691	1199	0	0	1354	1013	0	0	954	958
Otros	151	168	402	1033	162	26	345	680	194	11	378	662
Total	320	320	4928	4928	188	188	4134	4134	205	205	3439	3439

* 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.