

Fecha de Publicación: 21 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 17 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\$1829,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,0%.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	121,8	386,0	183,5	28,5	172,4	63,2	30,1
15-35	293,7	526,6	305,2	71,0	54,4	55,7	167,0
36-60	36,8	43,5	41,1	34,0	2,4	2,8	0,0
61-90	222,5	90,0	15,0	13,9	25,0	158,6	50,0
91-180	249,7	22,0	0,0	48,6	2,0	181,1	20,0
>180	90,4	44,1	0,0	59,4	14,1	1,0	30,0
Total	1014,8	1112,1	544,7	255,3	270,3	462,5	297,1

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

* 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**	169	153	2967	2862	28	160	2564	2895	11	195	2289	2053
Intragrupa y off-shore***	0	0	1789	1263	0	0	1560	1060	0	0	1086	1069
Otros	153	169	403	1035	160	28	551	721	195	11	441	694
Total	322	322	5160	5160	188	188	4676	4676	206	206	3815	3815

* 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.