

Fecha de Publicación: 30 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 28 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\$1369,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,8%.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	443,4	326,8	93,0	108,5	18,2	119,3	215,7
15-35	314,0	213,6	142,0	217,0	9,6	35,0	62,0
36-60	22,3	93,6	0,1	15,0	93,5	7,3	0,0
61-90	23,3	19,4	10,0	0,0	9,4	23,3	0,0
91-180	84,8	63,1	35,0	0,0	28,1	84,8	0,0
>180	11,9	30,9	30,0	0,0	0,9	11,9	0,0
Total	899,8	747,3	310,1	340,5	159,5	281,6	277,7

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

* 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	28 de Nov. al 2 de Diciembre				5 al 9 de Diciembre				12 al 16 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	172	2689	2579	6	601	2244	2554	20	118	1861	1838
Intragrupa y off-shore***	0	0	1354	1217	0	0	1229	747	0	0	1104	1047
Otros	172	19	513	759	601	6	324	496	118	20	368	448
Total	191	191	4555	4555	608	608	3797	3797	139	139	3334	3334

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.