

Fecha de Publicación: 15 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 10 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\$1130,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,3%.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	168,9	241,5	148,0	85,0	57,0	47,4	36,5
15-35	237,7	212,0	131,0	143,7	30,2	43,2	50,8
36-60	17,1	59,2	0,0	0,0	42,2	0,1	17,0
61-90	166,9	32,4	20,0	0,0	5,4	159,9	7,0
91-180	49,2	52,0	38,8	0,0	8,2	44,2	5,0
>180	0,0	10,2	10,0	0,0	0,2	0,0	0,0
Total	639,9	607,3	347,8	228,7	143,2	294,9	116,3

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

* 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**	19	102	2383	2251	159	165	2788	2585	13	151	2371	2352
Intragrupa y off-shore***	0	1	1482	1190	0	0	1610	1152	0	0	1296	988
Otros	102	18	309	733	165	159	377	1037	151	13	353	681
Total	121	121	4174	4174	324	324	4775	4775	164	164	4021	4021

* 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.