

Fecha de Publicación: 28 de Octubre de 2011
Fecha de Información: 26 de Octubre de 2011¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1162,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,7%.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	261,6	195,2	122,0	197,5	37,2	28,1	36,0
15-35	226,9	255,7	134,0	174,0	84,7	15,9	37,0
36-60	66,7	79,4	44,5	35,0	20,9	17,7	14,0
61-90	33,5	5,8	0,0	0,0	4,8	32,5	1,0
91-180	71,8	28,0	15,0	0,0	11,8	70,5	1,3
>180	15,9	16,5	6,0	0,0	5,5	10,9	5,0
Total	676,3	580,7	321,5	406,5	165,0	175,6	94,3

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

* 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	24 al 28 de Octubre				31 de Oct. al 4 de Noviembre				7 al 11 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	51	77	3489	2948	11	89	2557	2057	10	126	1808	1500
Intragrupa y off-shore***	0	0	1647	1710	0	0	1352	1224	0	0	1018	960
Otros	77	51	656	1134	89	11	340	969	126	10	242	609
Total	128	128	5792	5792	101	101	4250	4250	136	136	3069	3069

* 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.