

Fecha de Publicación: 11 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 09 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\$1333,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,1%.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	93,6	230,6	183,5	26,3	37,1	57,3	10,0
15-35	367,6	389,3	203,0	224,5	65,3	22,1	121,0
36-60	4,3	9,1	0,0	0,0	9,1	4,3	0,0
61-90	63,9	78,1	40,0	0,0	18,1	43,9	20,0
91-180	135,6	66,7	40,0	0,0	6,7	115,6	20,0
>180	48,0	32,0	15,0	30,0	2,0	3,0	15,0
Total	713,1	805,9	481,5	280,8	138,4	246,3	186,0

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

*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	103	2383	2258	129	178	2692	2419	13	158	2319	2260
Intragrupa y off-shore***	0	1	1482	1190	0	0	1475	1085	0	0	1283	971
Otros	103	18	316	733	178	129	361	1024	158	13	306	678
Total	123	123	4181	4181	307	307	4528	4528	172	172	3909	3909

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.