

Fecha de Publicación: 18 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 16 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\$1324,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.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	254,5	411,3	220,0	147,0	98,3	14,5	93,0
15-35	299,6	200,1	120,0	200,0	29,1	48,6	51,0
36-60	81,1	63,5	60,0	0,4	3,5	80,7	0,0
61-90	33,2	7,6	0,0	3,0	7,6	30,2	0,0
91-180	78,1	9,1	0,0	0,0	4,1	73,1	5,0
>180	21,8	13,3	0,0	17,0	13,3	4,8	0,0
Total	768,2	704,9	400,0	367,4	155,9	251,8	149,0

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

*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**	168	153	2946	2803	26	163	2496	2689	11	193	2241	1893
Intragrupa y off-shore***	0	0	1747	1258	0	0	1494	1036	0	0	981	1059
Otros	153	168	402	1034	163	26	426	692	193	11	393	663
Total	321	321	5095	5095	189	189	4417	4417	204	204	3614	3614

* 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.