

Fecha de Publicación: 22 de Noviembre de 2011
Fecha de Información: 18 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\$907,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.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	121,2	117,9	55,0	47,0	35,9	47,2	27,0
15-35	192,3	276,4	114,5	81,0	72,9	22,3	89,0
36-60	16,2	20,3	0,0	0,0	5,3	1,2	15,0
61-90	98,3	116,0	20,0	0,0	26,0	28,3	70,0
91-180	105,7	38,2	0,0	0,0	13,2	80,7	25,0
>180	7,9	23,4	5,0	0,9	18,4	7,0	0,0
Total	541,6	592,3	194,5	128,9	171,8	186,7	226,0

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

*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**	169	151	2964	2861	29	157	2611	2960	11	196	2322	2104
Intragrupa y off-shore***	0	0	1789	1263	0	0	1600	1097	0	0	1101	1079
Otros	151	169	403	1032	157	29	570	725	196	11	456	696
Total	319	319	5156	5156	186	186	4781	4781	207	207	3879	3879

* 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.