

Fecha de Publicación: 07 de Diciembre de 2011
Fecha de Información: 05 de Diciembre 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\$805,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,6%.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	182,4	228,7	139,2	101,5	33,5	24,9	56,0
15-35	183,2	122,6	74,0	137,5	25,4	22,5	23,2
36-60	89,8	17,2	0,0	30,0	17,2	59,8	0,0
61-90	0,4	1,8	0,0	0,0	1,8	0,4	0,0
91-180	3,6	25,1	0,0	0,0	25,1	3,6	0,0
>180	11,0	24,7	17,5	0,0	1,2	5,0	6,0
Total	470,4	420,0	230,7	269,0	104,1	116,2	85,2

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

* 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	5 al 9 de Diciembre				12 al 16 de Diciembre				19 al 23 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	438	2995	3382	26	414	2298	2273	5	195	1867	2272
Intragrupa y off-shore***	0	0	1643	1063	0	1	1206	1187	15	0	1143	737
Otros	438	30	401	594	414	25	515	559	180	5	394	394
Total	468	468	5038	5038	440	440	4019	4019	200	200	3403	3403

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.