

Fecha de Publicación: 8 de Diciembre de 2011
Fecha de Información: 06 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\$684,0 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	172,9	204,4	125,5	97,5	17,9	14,4	61,0
15-35	129,4	171,5	136,3	88,0	2,3	8,5	33,0
36-60	6,7	23,3	0,0	0,0	23,3	6,7	0,0
61-90	0,0	8,4	2,0	0,0	6,4	0,0	0,0
91-180	7,4	1,9	0,0	0,0	1,9	7,4	0,0
>180	40,9	11,2	10,0	0,8	1,2	40,1	0,0
Total	357,3	420,7	273,8	186,2	53,0	77,1	94,0

* 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	0,8 %	0,8 %	1,0 %	0,8 %
15-35	1,1 %	1,1 %	0,8 %	1,0 %
36-60	-	1,2 %	0,2 %	0,9 %
61-90	-	0,6 %	-	0,6 %
91-180	-	1,4 %	0,5 %	0,7 %
>180	-	0,9 %	0,6 %	0,7 %
Total	0,9 %	1,0 %	0,8 %	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	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**	29	439	3047	3425	34	415	2383	2420	5	195	1897	2306
Intragrupa y off-shore***	0	0	1673	1104	0	1	1301	1217	15	0	1169	763
Otros	439	29	403	594	415	32	524	571	180	5	395	392
Total	468	468	5123	5123	448	448	4209	4209	200	200	3461	3461

* 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.