

Fecha de Publicación: 12 de Diciembre de 2011
Fecha de Información: 07 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\$1121,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,5%.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	183,4	276,1	143,9	23,9	28,1	55,4	104,1
15-35	324,1	279,2	149,3	141,0	33,4	86,6	96,5
36-60	22,3	31,7	0,5	11,0	31,2	11,3	0,0
61-90	1,7	13,4	0,0	0,0	13,4	1,7	0,0
91-180	46,2	41,7	24,0	0,0	17,7	46,2	0,0
>180	23,7	99,1	30,0	0,0	48,7	3,3	20,4
Total	601,4	741,2	347,7	175,9	172,5	204,5	221,0

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

*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	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**	21	435	3052	3430	42	424	2509	2526	6	195	2031	2460
Intragrupa y off-shore***	0	0	1683	1104	3	1	1301	1241	15	0	1300	818
Otros	435	21	398	599	421	41	544	589	180	6	398	450
Total	456	456	5134	5134	466	466	4355	4355	201	201	3728	3728

* 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.