

Fecha de Publicación: 13 de Diciembre de 2011
Fecha de Información: 09 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\$606,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.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	223,4	235,7	73,5	54,1	6,2	13,3	156,0
15-35	104,9	118,0	90,0	97,0	23,0	2,9	5,0
36-60	0,1	3,6	0,4	0,0	3,2	0,1	0,0
61-90	5,8	9,7	5,0	5,0	4,7	0,8	0,0
91-180	27,1	16,4	10,0	0,0	6,4	27,1	0,0
>180	12,3	10,1	10,0	10,0	0,1	2,3	0,0
Total	373,5	393,5	188,9	166,1	43,6	46,4	161,0

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

*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	46	420	2639	2670	6	195	2121	2549
Intragrupa y off-shore***	0	0	1683	1104	3	1	1338	1257	15	0	1336	856
Otros	435	21	398	599	417	44	546	596	180	6	400	452
Total	456	456	5133	5133	466	466	4523	4523	202	202	3857	3857

* 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.