

Fecha de Publicación: 15 de Diciembre de 2011
Fecha de Información: 13 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\$682,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.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	119,9	139,7	80,0	27,8	15,1	47,5	44,6
15-35	134,7	183,4	90,6	97,3	62,7	7,4	30,0
36-60	22,9	56,0	4,5	0,0	31,5	2,9	20,0
61-90	8,1	5,4	1,7	0,0	3,7	8,1	0,0
91-180	17,8	2,0	0,0	0,0	2,0	17,8	0,0
>180	27,0	60,0	0,0	0,0	60,0	27,0	0,0
Total	330,3	446,6	176,8	125,1	175,1	110,6	94,6

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

* 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	12 al 16 de Diciembre				19 al 23 de Diciembre				26 al 30 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	52	416	2716	2873	7	199	2273	2633	5	325	1277	987
Intragrupa y off-shore***	3	1	1482	1323	15	0	1376	916	0	0	536	919
Otros	413	51	587	590	184	7	401	502	325	5	195	103
Total	468	468	4786	4786	206	206	4051	4051	330	330	2008	2008

* 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.