

Fecha de Publicación: 19 de Diciembre de 2011
Fecha de Información: 15 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\$716,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,8%.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	100,9	74,5	24,5	44,3	20,0	26,6	30,0
15-35	233,1	145,6	68,0	161,5	40,6	34,6	37,0
36-60	17,2	15,8	0,0	10,0	15,8	7,2	0,0
61-90	35,5	77,6	4,3	10,0	48,3	0,5	25,0
91-180	39,8	89,9	50,0	5,0	9,9	4,8	30,0
>180	8,2	0,8	0,0	0,0	0,8	8,2	0,0
Total	434,7	404,1	146,8	230,8	135,3	81,9	122,0

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

* 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	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**	51	399	2853	2970	10	179	2504	2925	5	326	1313	1022
Intragrupa y off-shore***	3	1	1493	1378	0	0	1543	1007	0	0	555	941
Otros	397	50	596	595	179	10	420	535	326	5	211	116
Total	451	451	4942	4942	190	190	4467	4467	331	331	2080	2080

* 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.