

Fecha de Publicación: 20 de Diciembre de 2011
 Fecha de Información: 16 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\$418,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,6%.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	97,0	105,9	58,8	70,0	27,1	7,0	20,0
15-35	83,8	56,9	26,1	51,5	4,3	5,8	26,5
36-60	9,2	2,1	0,0	0,0	2,1	9,2	0,0
61-90	37,6	42,1	0,0	0,0	12,1	7,6	30,0
91-180	16,7	2,1	0,0	3,7	2,1	13,0	0,0
>180	41,0	20,3	0,0	0,0	0,3	21,0	20,0
Total	285,3	229,5	84,9	125,2	48,1	63,6	96,5

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

* 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	398	2853	2968	11	170	2576	2965	5	326	1338	1086
Intragrupa y off-shore***	3	1	1493	1378	0	0	1578	1077	0	0	579	941
Otros	395	50	594	595	170	11	426	537	326	5	232	121
Total	450	450	4940	4940	181	181	4579	4579	331	331	2149	2149

* 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.