

Fecha de Publicación: 21 de Diciembre de 2011
Fecha de Información: 19 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\$669,3 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	100,4	24,9	9,5	86,5	5,4	3,9	10,0
15-35	112,1	287,5	199,0	25,0	32,5	31,1	56,0
36-60	62,5	59,4	10,7	0,0	8,7	22,5	40,0
61-90	3,0	7,2	0,0	0,0	7,2	3,0	0,0
91-180	4,5	3,9	0,0	0,0	3,9	4,5	0,0
>180	89,4	68,4	20,0	40,0	0,4	1,4	48,0
Total	371,9	451,4	239,2	151,5	58,2	66,4	154,0

* 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	3,6 %	2,9 %	0,7 %	1,8 %
15-35	1,1 %	1,9 %	1,6 %	1,7 %
36-60	1,1 %	2,8 %	1,3 %	1,4 %
61-90	-	2,3 %	1,2 %	2,0 %
91-180	-	2,9 %	1,0 %	1,9 %
>180	1,5 %	2,9 %	1,2 %	1,4 %
Total	1,4 %	2,1 %	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	19 al 23 de Diciembre				26 al 30 de Diciembre				2 al 6 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	173	2640	2956	5	326	1360	1110	3	57	920	1045
Intragrupa y off-shore***	0	0	1578	1153	0	0	588	952	0	0	745	532
Otros	173	10	416	526	326	5	236	122	57	3	79	168
Total	182	182	4634	4634	331	331	2184	2184	61	61	1744	1744

* 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.