

Fecha de Publicación: 22 de Diciembre de 2011
Fecha de Información: 20 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\$895,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.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	130,4	89,8	79,5	102,1	7,3	25,3	3,0
15-35	202,5	266,9	213,6	131,2	25,3	43,3	28,0
36-60	3,0	81,7	0,5	0,0	81,2	3,0	0,0
61-90	0,2	22,3	0,0	0,0	22,3	0,2	0,0
91-180	74,3	25,3	15,6	5,5	6,7	65,8	3,0
>180	17,5	31,5	15,0	0,0	0,5	1,5	16,0
Total	427,9	517,5	324,2	238,8	143,3	139,1	50,0

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

* 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**	8	172	2757	2971	5	330	1380	1185	3	60	922	1071
Intragrupa y off-shore***	0	0	1588	1237	0	0	657	970	0	0	770	532
Otros	172	8	418	555	330	5	242	124	60	3	80	170
Total	181	181	4763	4763	335	335	2279	2279	64	64	1772	1772

* 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.