

Fecha de Publicación: 30 de Diciembre de 2011
Fecha de Información: 28 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\$764,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -2,1%.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	160,4	144,0	106,7	115,7	20,3	27,7	17,0
15-35	184,5	105,0	34,0	155,5	54,5	12,5	16,5
36-60	22,2	43,5	43,0	5,0	0,5	17,2	0,0
61-90	11,0	3,5	0,0	0,1	3,5	10,9	0,0
91-180	23,4	28,0	0,0	1,5	28,0	21,9	0,0
>180	2,5	69,8	61,5	0,0	8,3	2,5	0,0
Total	404,0	393,7	245,2	277,8	115,0	92,7	33,5

* 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	-12,5 %	-3,6 %	-3,7 %	-4,3 %
15-35	-0,5 %	-3,7 %	-0,9 %	-1,6 %
36-60	-	-1,2 %	-2,7 %	-1,7 %
61-90	-	1,4 %	-0,6 %	-0,1 %
91-180	-	0,1 %	-0,9 %	-0,3 %
>180	-	1,1 %	-0,9 %	1,0 %
Total	-6,6 %	-1,7 %	-2,0 %	-2,1 %

* 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	26 al 30 de Diciembre				2 al 6 de Enero				9 al 13 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	307	1511	1356	16	71	1146	1232	8	87	1504	1740
Intragrupa y off-shore***	0	0	702	1053	0	0	856	697	0	0	1009	493
Otros	307	7	329	132	71	16	118	191	87	8	455	735
Total	314	314	2541	2541	88	88	2120	2120	95	95	2968	2968

* 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.