

Fecha de Publicación: 4 de Enero de 2012
 Fecha de Información: 02 de Enero de 2012 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\$266,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -3,1%.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 | 67,0 | 45,3 | 13,0 | 49,8 | 16,3 | 1,2 | 16,0 |
| 15-35 | 56,4 | 59,5 | 48,5 | 46,0 | 1,0 | 0,4 | 10,0 |
| 36-60 | 0,2 | 46,6 | 30,0 | 0,0 | 16,6 | 0,2 | 0,0 |
| 61-90 | 0,0 | 1,5 | 0,0 | 0,0 | 1,5 | 0,0 | 0,0 |
| 91-180 | 5,0 | 5,3 | 0,0 | 0,0 | 0,3 | 0,0 | 5,0 |
| >180 | 10,5 | 10,1 | 0,0 | 0,0 | 0,1 | 0,5 | 10,0 |
| Total | 139,1 | 168,2 | 91,5 | 95,8 | 35,7 | 2,3 | 41,0 |

* 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 | -17,4 % | 0,2 % | -3,3 % | -5,4 % |
| 15-35 | -1,7 % | -3,3 % | -2,8 % | -2,9 % |
| 36-60 | - | -0,9 % | -3,2 % | -1,0 % |
| 61-90 | - | 0,0 % | - | 0,0 % |
| 91-180 | 0,4 % | 0,9 % | - | 0,4 % |
| >180 | 0,3 % | 1,6 % | 0,7 % | 0,3 % |
| Total | -7,1 % | -1,8 % | -3,1 % | -3,1 % |

*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

| Sectores | 2 al 6 de Enero | | | | 9 al 13 de Enero | | | | 16 al 20 de Enero | | | |
|---------------------------|-----------------|-----------|-------------|-------------|------------------|-----------|-------------|-------------|-------------------|-----------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 16 | 61 | 1234 | 1265 | 10 | 88 | 1517 | 1807 | 5 | 72 | 1749 | 1739 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 872 | 768 | 0 | 1 | 1029 | 493 | 0 | 0 | 784 | 644 |
| Otros | 61 | 16 | 130 | 203 | 88 | 9 | 491 | 737 | 72 | 5 | 474 | 623 |
| Total | 77 | 77 | 2236 | 2236 | 99 | 99 | 3037 | 3037 | 77 | 77 | 3007 | 3007 |

* 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.