

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**		Intragruppo 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 intragruppo		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
Intragruppo 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 intragruppo.