

Fecha de Publicación: 5 de Enero de 2012
 Fecha de Información: 03 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\$1247,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,6%.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	180,0	197,0	93,4	67,0	24,1	33,5	79,5
15-35	400,1	367,4	133,3	226,0	128,6	68,6	105,5
36-60	1,8	60,0	17,0	0,0	43,0	1,8	0,0
61-90	7,3	128,4	40,0	0,0	88,4	7,3	0,0
91-180	49,9	11,8	0,0	45,0	11,8	4,9	0,0
>180	8,5	20,3	0,0	3,0	20,3	5,5	0,0
Total	647,5	784,9	283,6	341,0	316,3	121,5	185,0

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

*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

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	55	1296	1347	16	92	1579	1873	7	75	1861	1803
Intragruppo y off-shore***	0	0	927	806	0	1	1068	522	0	0	794	691
Otros	55	16	135	204	92	15	512	764	75	7	475	635
Total	71	71	2357	2357	108	108	3159	3159	81	81	3130	3130

* 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.