

Fecha de Publicación: 7 de Enero de 2012
 Fecha de Información: 04 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\$1169,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,3%.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	252,4	181,1	71,0	102,2	5,1	45,2	105,0
15-35	326,2	180,9	120,5	175,8	12,4	102,5	48,0
36-60	12,8	23,5	0,0	5,0	23,5	7,8	0,0
61-90	13,6	54,8	0,0	0,0	54,8	13,6	0,0
91-180	18,5	64,2	0,0	8,8	62,9	8,5	1,3
>180	63,1	142,2	108,0	40,0	24,2	13,1	10,0
Total	686,6	646,7	299,5	331,8	183,0	190,6	164,3

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

*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	53	1388	1399	18	92	1753	1971	7	74	1965	1850
Intragruppo y off-shore***	0	0	940	840	0	1	1104	589	0	0	816	712
Otros	53	16	139	204	92	17	515	805	74	7	475	641
Total	70	70	2466	2443	110	110	3372	3365	81	81	3255	3202

* 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.