

Fecha de Publicación: 11 de Enero de 2012
 Fecha de Información: 06 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\$1129,9 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	336,1	168,9	108,0	268,0	22,9	30,1	38,0
15-35	230,8	343,5	249,2	152,8	33,4	17,1	61,0
36-60	37,3	8,0	0,0	0,0	8,0	37,3	0,0
61-90	7,3	53,9	20,0	0,0	33,9	7,3	0,0
91-180	0,5	13,4	0,0	0,0	13,4	0,5	0,0
>180	15,5	23,7	0,0	5,0	13,7	0,5	10,0
Total	627,4	611,4	377,2	425,8	125,3	92,7	109,0

* 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	0,3 %	0,9 %	0,1 %	0,3 %
15-35	1,0 %	0,7 %	0,3 %	0,7 %
36-60	-	2,1 %	0,4 %	0,7 %
61-90	-	1,4 %	1,0 %	1,3 %
91-180	-	2,1 %	0,6 %	2,0 %
>180	1,8 %	1,5 %	1,7 %	1,6 %
Total	0,9 %	0,9 %	0,2 %	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	41	1376	1427	19	90	2105	2140	7	76	2047	1969
Intragruppo y off-shore***	0	0	964	850	0	1	1204	913	0	0	885	783
Otros	41	16	142	205	90	18	553	809	76	7	485	665
Total	58	58	2482	2482	109	109	3862	3862	83	83	3417	3417

* 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.