

Fecha de Publicación: 12 de Enero de 2012
 Fecha de Información: 10 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\$1170,2 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	298,8	155,8	78,0	180,0	15,8	56,8	62,0
15-35	225,5	306,3	226,5	192,5	58,8	12,1	21,0
36-60	42,0	26,9	0,0	0,0	26,9	42,0	0,0
61-90	6,2	54,1	0,1	0,0	54,0	6,2	0,0
91-180	15,5	40,4	0,0	0,5	40,4	15,0	0,0
>180	10,0	71,7	15,5	10,0	56,2	0,0	0,0
Total	598,1	655,1	320,1	383,0	252,0	132,1	83,0

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

Sector	9 al 13 de Enero				16 al 20 de Enero				23 al 27 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	93	2181	2184	7	77	2198	2055	5	143	1411	1546
Intragruppo y off-shore***	0	1	1219	1009	0	0	948	867	0	0	1009	485
Otros	93	19	535	742	77	7	492	717	143	5	305	694
Total	113	113	3935	3935	83	83	3638	3638	148	148	2725	2725

* 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.