

Fecha de Publicación: 13 de Enero de 2012
 Fecha de Información: 11 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\$1499,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	369,7	281,7	88,3	285,5	125,3	16,2	68,0
15-35	212,5	404,8	268,7	164,0	105,1	17,5	31,0
36-60	50,9	32,2	5,0	40,0	27,2	10,9	0,0
61-90	19,8	31,3	0,0	0,0	31,3	19,8	0,0
91-180	96,4	52,8	0,4	0,0	47,4	91,4	5,0
>180	11,2	39,8	11,3	1,0	28,5	10,2	0,0
Total	760,5	842,5	373,7	490,5	364,9	166,0	104,0

* Cifras en millones de dólares

** Incluye operaciones interbancarias y operaciones 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,2 %	0,6 %	-0,1 %	0,2 %
15-35	-15,6 %	0,6 %	0,1 %	-0,5 %
36-60	-	1,9 %	0,5 %	1,0 %
61-90	-	1,5 %	0,6 %	1,2 %
91-180	1,2 %	1,6 %	0,9 %	1,1 %
>180	-	1,7 %	1,3 %	1,6 %
Total	-4,5 %	0,9 %	0,2 %	0,2 %

* 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	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	88	2274	2355	7	80	2365	2148	5	143	1520	1632
Intragrupa y off-shore***	0	1	1291	1101	0	0	964	961	0	0	1069	587
Otros	88	20	626	735	80	7	510	730	143	5	331	701
Total	109	109	4190	4190	86	86	3838	3838	149	149	2920	2920

* 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 intragrupo.