

Fecha de Publicación: 16 de Enero de 2012
 Fecha de Información: 12 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\$1072,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.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	221,0	191,5	27,0	91,0	75,5	41,0	89,0
15-35	288,8	260,8	113,7	149,0	48,1	40,8	99,0
36-60	20,1	30,7	10,0	0,0	20,7	20,1	0,0
61-90	47,8	39,5	5,0	5,0	19,5	27,8	15,0
91-180	45,6	55,3	5,7	5,0	49,6	40,6	0,0
>180	5,7	73,4	15,5	0,7	52,9	0,0	5,0
Total	629,0	651,1	176,9	250,7	266,2	170,3	208,0

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

*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	84	2318	2402	8	81	2420	2173	5	143	1677	1784
Intragruppo y off-shore***	0	1	1303	1139	0	0	984	979	0	0	1069	622
Otros	84	20	661	741	81	8	515	767	143	5	365	704
Total	105	105	4282	4282	90	90	3919	3919	149	149	3111	3111

* 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.