

Fecha de Publicación: 18 de Enero de 2012
 Fecha de Información: 16 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\$433,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.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	79,9	112,9	31,0	76,0	81,9	3,9	0,0
15-35	111,2	19,7	5,5	28,5	6,2	74,7	8,0
36-60	15,8	21,2	0,0	10,4	21,2	5,4	0,0
61-90	0,1	9,6	0,0	0,0	9,6	0,1	0,0
91-180	22,0	15,9	0,0	0,0	15,9	22,0	0,0
>180	1,0	32,0	31,6	0,0	0,4	1,0	0,0
Total	230,1	211,3	68,1	114,9	135,2	107,2	8,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	0,5 %	0,3 %	0,4 %
15-35	0,2 %	2,5 %	0,7 %	0,8 %
36-60	-	1,9 %	0,6 %	1,4 %
61-90	-	2,3 %	0,3 %	2,2 %
91-180	-	2,6 %	1,2 %	1,8 %
>180	-	1,9 %	1,7 %	1,8 %
Total	0,2 %	1,0 %	0,7 %	0,9 %

*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	16 al 20 de Enero				23 al 27 de Enero				30 de Ene. al 3 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	91	2593	2377	5	146	1733	1860	5	192	1612	1402
Intragruppo y off-shore***	0	0	1105	1111	0	0	1139	674	0	0	845	705
Otros	91	9	597	806	146	5	371	709	192	5	269	619
Total	100	100	4295	4295	151	151	3243	3243	197	197	2726	2726

* 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.