

Fecha de Publicación: 19 de Enero de 2012
 Fecha de Información: 17 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\$1364,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.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	247,1	163,9	46,0	123,0	39,9	46,1	78,0
15-35	307,5	274,8	172,0	193,5	48,4	59,5	54,5
36-60	49,3	40,0	5,0	0,0	16,0	30,3	19,0
61-90	6,1	22,4	0,0	5,0	22,4	1,1	0,0
91-180	35,1	134,1	100,0	15,0	14,1	0,1	20,0
>180	231,9	70,8	15,0	100,0	8,8	84,9	47,0
Total	876,9	706,0	338,0	436,5	149,5	221,9	218,5

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

*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	84	2763	2501	8	144	1793	1887	5	195	1627	1452
Intragruppo y off-shore***	0	0	1151	1192	0	0	1139	709	0	0	875	712
Otros	84	9	612	833	144	8	382	718	195	5	288	626
Total	93	93	4526	4526	152	152	3314	3314	200	200	2790	2790

* 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.