

Fecha de Publicación: 23 de Diciembre de 2011
 Fecha de Información: 21 de Diciembre de 2011 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\$521,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,1%.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	171,9	158,0	34,5	44,0	2,5	6,9	121,0
15-35	119,5	123,7	83,7	51,0	18,0	46,5	22,0
36-60	4,4	12,8	0,0	0,0	12,8	4,4	0,0
61-90	3,3	0,4	0,0	0,0	0,4	3,3	0,0
91-180	4,0	4,0	0,0	0,0	4,0	4,0	0,0
>180	24,5	51,4	37,3	0,0	1,1	11,5	13,0
Total	327,6	350,3	155,5	95,0	38,8	76,6	156,0

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

*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	19 al 23 de Diciembre				26 al 30 de Diciembre				2 al 6 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	174	2870	3099	5	330	1431	1219	3	60	935	1073
Intragruppo y off-shore***	0	0	1621	1254	0	0	659	984	0	0	770	545
Otros	174	8	431	569	330	5	236	123	60	3	83	170
Total	182	182	4922	4922	335	335	2326	2326	64	64	1788	1788

* 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.