

Fecha de Publicación: 27 de Diciembre de 2011
 Fecha de Información: 23 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\$218,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,6%.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	33,9	32,2	0,0	0,8	3,2	4,1	29,0
15-35	71,3	56,4	37,0	18,5	8,4	41,8	11,0
36-60	9,6	4,8	0,0	0,0	4,8	9,6	0,0
61-90	3,9	9,2	5,0	0,0	4,2	3,9	0,0
91-180	2,2	30,9	16,7	0,0	14,1	2,2	0,0
>180	3,8	0,3	0,0	0,0	0,3	3,8	0,0
Total	124,7	133,7	58,7	19,3	35,0	65,5	40,0

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

* 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	166	2948	3105	8	318	1463	1240	3	67	979	1105
Intragrupa y off-shore***	0	0	1633	1303	0	0	663	1009	0	0	770	557
Otros	166	8	425	599	318	8	252	129	67	3	86	173
Total	174	174	5007	5007	326	326	2378	2378	70	70	1835	1835

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.