

Fecha de Publicación: 3 de Enero de 2012
 Fecha de Información: 29 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\$855,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -2,5%.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	34,7	105,7	23,0	22,5	82,7	12,2	0,0
15-35	65,4	178,4	26,5	51,0	143,9	6,4	8,0
36-60	5,6	94,1	0,0	0,0	94,1	5,6	0,0
61-90	37,7	143,4	0,0	0,0	108,4	2,7	35,0
91-180	12,5	165,6	0,0	0,0	165,6	12,5	0,0
>180	24,7	32,5	6,0	5,9	25,0	17,3	1,5
Total	180,6	719,7	55,5	79,4	619,7	56,7	44,5

* 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	-	-7,3 %	-12,9 %	-8,8 %
15-35	-2,9 %	-2,5 %	-4,2 %	-3,0 %
36-60	-	-1,9 %	-5,7 %	-2,1 %
61-90	-1,5 %	-1,0 %	-1,4 %	-1,1 %
91-180	-	-0,1 %	-1,2 %	-0,2 %
>180	-0,3 %	0,8 %	-1,0 %	0,1 %
Total	-1,7 %	-2,0 %	-5,5 %	-2,5 %

*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	26 al 30 de Diciembre				2 al 6 de Enero				9 al 13 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	6	307	1512	1818	16	67	1180	1246	9	88	1505	1780
Intragruppo y off-shore***	0	0	702	1053	0	0	859	719	0	0	1029	493
Otros	307	6	791	133	67	16	129	203	88	9	476	736
Total	313	313	3004	3004	84	84	2168	2168	97	97	3009	3009

* 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.