

Fecha de Publicación: 05 de Diciembre de 2011
Fecha de Información: 01 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\$1069,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,5%.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	193,2	161,5	89,0	70,3	22,5	72,8	50,0
15-35	316,4	329,6	144,0	143,5	68,6	55,9	117,0
36-60	20,5	48,1	2,4	0,0	45,7	20,5	0,0
61-90	47,4	19,4	0,0	35,0	9,4	2,4	10,0
91-180	42,6	12,9	0,0	10,0	2,9	22,6	10,0
>180	38,0	36,9	25,0	20,0	1,9	8,0	10,0
Total	657,9	608,3	260,4	278,8	151,0	182,1	197,0

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

* 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

Sector	28 de Nov. al 2 de Diciembre				5 al 9 de Diciembre				12 al 16 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	136	2973	2751	25	744	2771	3023	26	115	2030	2114
Intragrupa y off-shore***	0	0	1437	1439	0	0	1376	942	0	1	1182	1093
Otros	136	19	561	781	744	25	376	559	115	25	500	506
Total	155	155	4971	4971	769	769	4524	4524	141	141	3712	3712

* 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.