

Fecha de Publicación: 06 de Diciembre de 2011
Fecha de Información: 02 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\$1174,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,4%.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	296,5	266,1	119,0	89,2	16,1	76,3	131,0
15-35	204,9	235,4	170,0	141,0	15,4	13,9	50,0
36-60	16,5	12,8	0,0	0,0	2,8	6,5	10,0
61-90	100,7	29,7	25,0	90,0	4,7	10,7	0,0
91-180	51,0	55,2	6,0	15,0	49,1	35,9	0,1
>180	49,9	54,5	25,0	40,0	21,6	2,0	7,9
Total	719,4	653,7	345,0	375,2	109,7	145,2	199,0

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

* 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	134	2973	2751	30	446	2881	3198	26	414	2212	2204
Intragrupa y off-shore***	0	0	1437	1439	0	0	1490	977	0	1	1187	1147
Otros	134	19	561	781	446	30	391	587	414	25	500	549
Total	153	153	4971	4971	476	476	4761	4761	440	440	3900	3900

* 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.