

Fecha de Publicación: 27 de Enero de 2012
 Fecha de Información: 25 de Enero de 2012 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\$1308,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.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	143,7	96,8	65,9	119,6	10,9	4,1	20,0
15-35	257,5	440,3	327,9	138,8	22,6	28,9	89,8
36-60	84,0	42,6	0,0	3,0	22,6	61,0	20,0
61-90	6,6	15,7	0,0	0,0	15,7	6,6	0,0
91-180	54,3	35,0	15,0	3,0	20,0	51,3	0,0
>180	228,1	54,5	10,0	205,0	23,5	2,1	21,0
Total	774,2	684,9	418,8	469,4	115,3	154,0	150,8

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

*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

Sector	23 al 27 de Enero				30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	99	2348	2582	5	202	2025	1706	3	180	1607	1580
Intragruppo y off-shore***	0	0	1443	1003	0	0	1078	1010	0	0	1055	670
Otros	99	8	624	831	202	5	310	698	180	3	224	636
Total	107	107	4415	4415	207	207	3413	3413	183	183	2886	2886

* 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.