

Fecha de Publicación: 1 de Febrero de 2012
 Fecha de Información: 30 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\$786,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,6%.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	85,1	167,1	62,0	37,3	94,1	36,8	11,0
15-35	158,7	132,9	72,0	75,5	36,9	59,2	24,0
36-60	174,5	71,9	0,0	0,0	16,9	119,5	55,0
61-90	30,7	20,0	0,0	0,0	20,0	30,7	0,0
91-180	5,6	14,8	0,0	0,0	14,8	5,6	0,0
>180	6,0	9,0	0,0	0,0	9,0	6,0	0,0
Total	460,5	415,8	134,0	112,8	191,8	257,8	90,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,4 %	0,9 %	0,9 %	0,9 %
15-35	1,6 %	1,9 %	1,7 %	1,8 %
36-60	2,0 %	2,4 %	1,7 %	1,8 %
61-90	-	2,6 %	2,0 %	2,2 %
91-180	-	2,8 %	1,5 %	2,5 %
>180	-	2,8 %	1,8 %	2,4 %
Total	1,8 %	1,6 %	1,6 %	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	30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero				13 al 17 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	5	188	2273	2059	3	178	1760	1840	4	149	2704	1918
Intragruppo y off-shore***	0	0	1214	1142	0	0	1214	718	0	0	1135	992
Otros	188	5	448	733	178	3	248	665	149	4	394	1322
Total	193	193	3934	3934	181	181	3223	3223	152	152	4233	4233

* 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.