

Fecha de Publicación: 3 de Febrero de 2012
Fecha de Información: 01 de Febrero 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\$1109,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,2%.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 | 49,3 | 176,4 | 39,5 | 15,0 | 117,9 | 15,3 | 19,0 |
| 15-35 | 291,2 | 311,0 | 188,0 | 131,0 | 56,5 | 93,7 | 66,5 |
| 36-60 | 22,7 | 21,9 | 0,0 | 0,0 | 21,9 | 22,7 | 0,0 |
| 61-90 | 114,8 | 23,5 | 0,0 | 0,0 | 8,5 | 99,8 | 15,0 |
| 91-180 | 1,7 | 24,5 | 0,0 | 0,0 | 24,5 | 1,7 | 0,0 |
| >180 | 135,4 | 37,1 | 0,0 | 135,0 | 37,1 | 0,4 | 0,0 |
| Total | 615,1 | 594,3 | 227,5 | 281,0 | 266,3 | 233,6 | 100,5 |

* 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 intragrupo | | Total |
|--------------|--------------------|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 3,3 % | 0,7 % | 1,8 % | 1,1 % |
| 15-35 | 1,8 % | 2,4 % | 1,8 % | 2,1 % |
| 36-60 | - | 3,5 % | 2,1 % | 2,8 % |
| 61-90 | 3,1 % | 3,2 % | 2,5 % | 2,6 % |
| 91-180 | - | 3,0 % | 1,9 % | 2,9 % |
| >180 | - | 2,9 % | 3,0 % | 3,0 % |
| Total | 2,3 % | 2,0 % | 2,3 % | 2,2 % |

* 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 | 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** | 4 | 182 | 2382 | 2227 | 9 | 180 | 1830 | 2008 | 11 | 149 | 2758 | 2033 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1273 | 1177 | 0 | 0 | 1249 | 724 | 0 | 0 | 1178 | 998 |
| Otros | 182 | 4 | 486 | 736 | 180 | 9 | 330 | 679 | 149 | 11 | 431 | 1336 |
| Total | 187 | 187 | 4140 | 4140 | 189 | 189 | 3410 | 3410 | 160 | 160 | 4367 | 4367 |

* 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.