

Fecha de Publicación: 9 de Febrero de 2012
 Fecha de Información: 07 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\$1306,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.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	302,1	490,5	223,0	127,5	99,5	6,6	168,0
15-35	264,1	239,2	120,0	109,0	20,2	56,1	99,0
36-60	67,0	32,9	0,0	0,0	12,9	47,0	20,0
61-90	63,7	23,8	0,0	25,0	23,8	38,7	0,0
91-180	0,5	26,6	0,0	0,0	26,6	0,5	0,0
>180	63,0	41,5	10,0	30,0	10,5	12,0	21,0
Total	760,4	854,4	353,0	291,5	193,4	160,9	308,0

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

*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

Sectores	6 al 10 de Febrero				13 al 17 de Febrero				20 al 24 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	196	2398	2688	14	153	2951	2629	6	183	1595	1975
Intragruppo y off-shore***	0	0	1478	881	0	2	1523	1025	0	0	1228	456
Otros	196	9	460	767	153	12	532	1352	183	6	261	653
Total	205	205	4336	4336	167	167	5005	5005	189	189	3083	3083

* 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.