

Fecha de Publicación: 11 de Febrero de 2012
 Fecha de Información: 09 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\$1968,9 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	285,2	742,8	381,0	143,0	256,8	37,2	105,0
15-35	331,7	351,3	213,8	183,0	48,1	59,2	89,5
36-60	34,8	18,4	0,0	12,0	8,4	12,8	10,0
61-90	34,6	35,1	20,0	0,0	10,1	29,6	5,0
91-180	225,3	76,4	5,6	15,0	50,8	190,3	20,0
>180	24,2	38,6	0,0	0,0	38,6	24,2	0,0
Total	935,8	1262,6	620,4	353,0	412,8	353,3	229,5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,0 %	2,9 %	0,5 %	2,7 %
15-35	2,3 %	2,2 %	1,9 %	2,1 %
36-60	3,5 %	3,9 %	1,6 %	2,5 %
61-90	3,4 %	2,1 %	2,6 %	2,4 %
91-180	2,2 %	2,9 %	2,6 %	2,6 %
>180	-	3,1 %	2,5 %	2,9 %
Total	3,2 %	2,7 %	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	191	2501	2938	13	160	3303	3539	6	184	1674	2119
Intragruppo y off-shore***	0	0	1651	896	7	2	1925	1161	0	0	1318	480
Otros	191	9	471	790	152	12	860	1387	184	6	275	668
Total	200	200	4623	4623	173	173	6088	6088	190	190	3267	3267

* 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.