

Fecha de Publicación: 17 de Febrero de 2012
 Fecha de Información: 15 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\$1835,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	316,3	414,3	131,0	149,3	167,8	51,6	115,5
15-35	364,1	465,8	318,5	169,2	42,8	90,4	104,5
36-60	12,9	9,9	0,0	10,0	9,9	2,9	0,0
61-90	260,1	154,7	60,0	0,0	34,7	200,1	60,0
91-180	29,0	37,3	0,0	0,0	37,3	29,0	0,0
>180	40,7	40,9	0,0	0,0	10,9	10,7	30,0
Total	1023,1	1122,8	509,5	328,5	303,3	384,6	310,0

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

*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	13 al 17 de Febrero				20 al 24 de Febrero				27 de Feb. al 2 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	168	4033	4527	12	186	1795	2412	8	292	2501	2240
Intragruppo y off-shore***	7	2	2227	1411	0	0	1518	549	0	0	1029	1065
Otros	161	12	1133	1455	186	12	324	675	292	8	613	838
Total	182	182	7393	7393	199	199	3637	3637	300	300	4143	4143

* 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.