

Fecha de Publicación: 1 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 28 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\$1417,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.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	239,5	334,3	283,0	198,6	29,3	18,9	22,0
15-35	346,2	251,6	139,1	203,3	16,5	47,0	96,0
36-60	25,1	57,1	45,0	0,0	12,1	25,1	0,0
61-90	0,9	9,9	0,0	0,0	9,9	0,9	0,0
91-180	166,6	95,6	0,0	40,0	35,6	66,6	60,0
>180	49,4	19,2	0,0	35,0	19,2	14,4	0,0
Total	827,7	767,7	467,1	476,9	122,6	172,9	178,0

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

*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	27 de Feb. al 2 de Marzo				5 al 9 de Marzo				12 al 16 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	285	3207	2897	4	139	2439	2697	2	156	2170	2829
Intragruppo y off-shore***	0	0	1505	1362	0	0	1363	1104	0	0	1714	882
Otros	285	12	700	1152	139	4	497	498	156	2	371	544
Total	297	297	5411	5411	143	143	4299	4299	158	158	4256	4256

* 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.