

Fecha de Publicación: 2 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 29 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\$1700,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.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	291,3	252,2	138,0	152,5	61,6	86,2	52,6
15-35	559,4	591,1	195,0	155,4	94,1	102,1	302,0
36-60	40,4	30,3	0,0	0,0	30,3	40,4	0,0
61-90	5,2	35,9	0,0	0,0	35,9	5,2	0,0
91-180	114,7	87,6	0,0	60,0	64,6	31,7	23,0
>180	46,5	23,5	0,0	45,0	23,5	1,5	0,0
Total	1057,4	1020,6	333,0	412,9	310,0	267,0	377,6

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

*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**	11	259	3277	2972	4	139	2638	2794	2	157	2231	2925
Intragruppo y off-shore***	0	0	1555	1401	0	0	1398	1203	0	0	1778	897
Otros	259	11	709	1168	139	4	526	566	157	2	398	585
Total	270	270	5541	5541	143	143	4562	4562	159	159	4408	4408

* 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.