

Fecha de Publicación: 05 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 01 de Marzo 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\$1077,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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	208,1	288,0	183,5	71,8	10,5	42,2	94,0
15-35	323,4	232,1	175,5	159,3	11,6	119,2	45,0
36-60	40,4	24,6	0,0	0,0	24,6	40,4	0,0
61-90	1,0	20,3	10,0	0,0	10,3	1,0	0,0
91-180	4,1	23,4	0,0	0,0	23,4	4,1	0,0
>180	28,4	28,1	0,0	20,0	23,1	3,4	5,0
Total	605,4	616,4	369,0	251,1	103,4	210,4	144,0

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

*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	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	3338	3085	14	140	2747	2939	9	157	2256	2955
Intragruppo y off-shore***	0	0	1624	1421	0	2	1486	1228	0	0	1804	922
Otros	259	11	710	1167	140	12	532	597	157	9	402	585
Total	270	270	5672	5672	154	154	4765	4765	166	166	4462	4462

* 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.