

Fecha de Publicación: 7 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 05 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\$1059,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	209,0	399,3	204,5	19,0	14,8	10,0	180,0
15-35	245,3	321,1	222,5	146,5	17,1	17,3	81,5
36-60	43,8	29,1	0,0	5,0	4,1	13,8	25,0
61-90	4,1	3,0	0,0	0,0	3,0	4,1	0,0
91-180	34,4	46,1	0,0	25,0	41,1	4,4	5,0
>180	5,0	15,7	0,0	0,0	10,7	0,0	5,0
Total	541,6	814,3	427,0	195,5	90,8	49,6	296,5

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

*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	5 al 9 de Marzo				12 al 16 de Marzo				19 al 23 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	129	3074	3393	11	158	2381	3112	11	93	1756	2104
Intragruppo y off-shore***	0	2	1752	1298	0	0	1868	957	0	0	1199	704
Otros	129	13	552	687	158	11	421	601	93	11	456	602
Total	143	143	5379	5379	170	170	4670	4670	104	104	3411	3411

* 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.