

Fecha de Publicación: 8 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 06 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\$1454,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	175,4	307,1	207,0	73,0	20,1	22,4	80,0
15-35	464,7	461,2	324,9	269,0	8,3	67,7	128,0
36-60	68,6	38,3	0,0	28,0	1,3	3,6	37,0
61-90	59,0	7,6	0,0	0,0	7,6	59,0	0,0
91-180	20,9	29,5	10,0	5,0	19,5	15,9	0,0
>180	46,0	26,8	15,0	35,0	6,8	6,0	5,0
Total	834,5	870,4	556,9	410,0	63,5	174,5	250,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-1,7 %	5,6 %	4,8 %	3,8 %
15-35	4,5 %	4,2 %	4,1 %	4,3 %
36-60	4,5 %	5,3 %	4,5 %	4,5 %
61-90	-	4,2 %	4,1 %	4,1 %
91-180	-	3,8 %	3,3 %	3,6 %
>180	2,8 %	2,2 %	1,6 %	2,0 %
Total	2,5 %	4,7 %	4,1 %	4,0 %

*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**	17	130	3133	3654	11	161	2461	3144	11	93	1827	2124
Intragrupa y off-shore***	0	2	1951	1298	0	0	1876	1012	0	0	1199	759
Otros	130	15	554	686	161	11	434	616	93	11	466	608
Total	146	146	5638	5638	173	173	4771	4771	104	104	3491	3491

* 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 intragrupo.