

Fecha de Publicación: 09 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 07 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\$1268,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.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	301,3	267,1	123,5	147,5	49,6	59,8	94,0
15-35	291,3	303,6	228,0	171,6	11,0	55,1	64,6
36-60	28,5	4,9	0,0	0,0	4,9	28,5	0,0
61-90	66,7	90,9	0,0	0,0	55,9	31,7	35,0
91-180	34,1	9,7	0,0	32,0	9,7	2,1	0,0
>180	45,0	33,3	0,0	30,0	19,3	1,0	14,0
Total	766,7	709,4	351,5	381,1	150,3	178,0	207,6

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones 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	5,5 %	10,1 %	3,2 %	5,5 %
15-35	4,6 %	4,3 %	4,1 %	4,3 %
36-60	-	5,1 %	3,8 %	4,0 %
61-90	3,8 %	3,8 %	3,7 %	3,8 %
91-180	-	4,0 %	0,3 %	1,4 %
>180	3,2 %	3,5 %	2,8 %	3,4 %
Total	4,8 %	5,7 %	3,5 %	4,5 %

*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	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	126	3248	3717	11	158	2603	3264	11	94	1898	2239
Intragruppo y off-shore***	0	2	1974	1376	0	0	1926	1082	0	0	1260	779
Otros	126	15	569	699	158	11	485	669	94	11	470	609
Total	143	143	5791	5791	170	170	5014	5014	105	105	3627	3627

* 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.