

Fecha de Publicación: 15 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 13 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\$1533,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,5%.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	297,8	494,5	62,0	68,0	245,5	42,8	187,0
15-35	258,5	338,7	160,7	89,0	61,0	52,5	117,0
36-60	141,8	70,8	35,0	0,0	25,8	131,8	10,0
61-90	38,6	13,4	10,0	0,0	3,4	38,6	0,0
91-180	16,1	61,4	5,0	10,0	56,4	6,1	0,0
>180	28,2	87,1	50,2	22,8	36,9	5,4	0,0
Total	781,1	1066,0	322,9	189,8	429,1	277,3	314,0

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

*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	12 al 16 de Marzo				19 al 23 de Marzo				26 al 30 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	171	3364	4040	11	95	2088	2358	17	212	2874	2870
Intragruppo y off-shore***	5	0	2327	1318	0	0	1266	784	0	0	1275	760
Otros	165	13	503	835	95	11	501	712	212	17	635	1155
Total	183	183	6193	6193	106	106	3854	3854	229	229	4784	4784

* 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.