

Fecha de Publicación: 16 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 14 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\$853,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.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	142,9	83,2	47,0	57,9	7,2	56,1	29,0
15-35	171,5	310,6	230,4	26,0	12,2	77,5	68,0
36-60	13,7	5,8	0,0	0,0	5,8	13,7	0,0
61-90	83,9	7,6	0,0	12,7	7,6	71,2	0,0
91-180	26,1	20,5	0,0	25,0	20,5	1,1	0,0
>180	69,2	25,6	0,0	50,0	15,6	9,2	10,0
Total	507,3	453,3	277,4	171,6	68,9	228,7	107,0

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

*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**	14	165	3420	4104	11	103	2109	2370	17	218	2947	2867
Intragrupa y off-shore***	5	0	2364	1336	0	0	1276	784	0	0	1275	800
Otros	160	14	507	852	103	11	496	726	218	17	632	1188
Total	179	179	6291	6291	114	114	3881	3881	235	235	4855	4855

* 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.