

Fecha de Publicación: 21 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 16 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\$1296,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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	266,6	373,8	235,2	117,1	17,6	28,5	121,0
15-35	215,2	338,5	245,0	54,0	26,5	94,2	67,0
36-60	13,3	6,8	0,0	0,0	6,6	13,1	0,2
61-90	9,8	76,9	28,3	0,0	43,6	4,8	5,0
91-180	55,1	35,8	0,0	5,0	35,8	50,1	0,0
>180	77,5	45,4	5,0	52,5	15,4	0,0	25,0
Total	637,5	877,1	513,5	228,6	145,5	190,7	218,2

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

*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	166	3486	4156	15	109	2265	2723	18	218	3144	2927
Intragruppo y off-shore***	5	0	2379	1392	0	0	1522	911	0	0	1275	802
Otros	161	14	535	853	109	15	498	651	218	18	633	1323
Total	180	180	6400	6400	124	124	4285	4285	236	236	5052	5052

* 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.