

Fecha de Publicación: 22 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 20 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\$899,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,9%.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	310,6	297,5	134,0	97,3	27,5	77,3	136,0
15-35	152,7	87,2	54,3	106,5	17,9	31,2	15,0
36-60	68,6	54,5	10,0	0,0	4,5	28,6	40,0
61-90	1,1	16,0	12,0	0,0	4,0	1,1	0,0
91-180	25,5	50,4	10,0	0,0	30,4	15,5	10,0
>180	11,4	30,1	1,0	5,0	24,1	1,4	5,0
Total	570,0	535,7	221,3	208,8	108,4	155,2	206,0

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

*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	19 al 23 de Marzo				26 al 30 de Marzo				2 al 6 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	111	2423	2839	19	220	3265	3024	0	56	1650	1990
Intragruppo y off-shore***	0	0	1567	965	0	0	1321	845	0	0	1138	762
Otros	111	13	506	692	220	19	640	1358	56	0	273	309
Total	125	125	4496	4496	239	239	5227	5227	56	56	3061	3061

* 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.