

Fecha de Publicación: 10 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 08 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\$1332,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.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	213,3	245,2	153,6	92,2	46,5	76,1	45,0
15-35	227,1	288,7	213,0	140,1	10,7	22,0	65,0
36-60	38,1	52,1	0,0	10,0	52,1	28,1	0,0
61-90	81,0	88,7	15,7	40,0	48,0	16,0	25,0
91-180	68,3	111,7	0,0	20,0	63,7	0,3	48,0
>180	70,4	60,8	0,0	40,4	30,8	0,0	30,0
Total	698,2	847,2	382,3	342,7	251,9	142,5	213,0

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

*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	122	3297	3779	13	163	2741	3413	11	95	1925	2271
Intragrupa y off-shore***	0	2	2021	1421	5	0	2028	1129	0	0	1260	779
Otros	122	15	584	703	158	13	507	735	95	11	483	616
Total	139	139	5902	5902	176	176	5277	5277	106	106	3667	3667

* 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.