

Fecha de Publicación: 31 de Enero de 2012
 Fecha de Información: 27 de Enero 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\$701,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,6%.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	134,0	241,6	178,3	99,2	47,4	18,8	16,0
15-35	176,1	110,1	64,0	111,3	13,9	32,6	32,3
36-60	30,5	24,9	0,0	0,0	24,9	30,5	0,0
61-90	1,5	3,4	0,0	0,0	3,4	1,5	0,0
91-180	0,2	14,7	0,0	0,0	14,7	0,2	0,0
>180	5,3	7,3	0,0	5,0	7,3	0,3	0,0
Total	347,5	402,1	242,3	215,5	111,6	83,8	48,3

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

*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

Sector	23 al 27 de Enero				30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	93	2446	2634	5	198	2232	1949	3	182	1724	1787
Intragruppo y off-shore***	0	0	1447	1032	0	0	1195	1117	0	0	1171	706
Otros	93	8	633	860	198	5	363	723	182	3	242	645
Total	100	100	4526	4526	203	203	3789	3789	185	185	3137	3137

* 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.