

Fecha de Publicación: 2 de Febrero de 2012
 Fecha de Información: 31 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\$738,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,0%.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	139,3	184,9	76,0	26,0	6,9	11,3	102,0
15-35	188,5	195,4	109,5	100,0	46,8	49,4	39,1
36-60	70,2	39,9	14,5	10,0	22,4	57,2	3,0
61-90	10,7	27,9	15,0	0,0	12,9	10,7	0,0
91-180	0,8	6,2	0,0	0,0	6,2	0,8	0,0
>180	16,9	7,6	0,0	10,0	1,6	0,9	6,0
Total	426,4	461,8	215,0	146,0	96,7	130,3	150,1

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

*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	30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero				13 al 17 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	4	182	2350	2160	3	179	1821	1925	4	149	2732	1959
Intragruppo y off-shore***	0	0	1257	1165	0	0	1247	721	0	0	1157	992
Otros	182	4	453	735	179	3	250	673	149	4	399	1335
Total	186	186	4060	4060	182	182	3319	3319	153	153	4287	4287

* 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.