

Fecha de Publicación: 4 de Febrero de 2012
 Fecha de Información: 02 de Febrero 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\$1428,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.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	123,7	179,9	75,0	12,7	34,8	40,9	70,1
15-35	481,0	419,5	153,3	238,5	83,0	59,3	183,3
36-60	22,4	44,5	0,1	0,0	44,4	22,4	0,0
61-90	98,5	171,0	100,0	0,0	15,0	42,5	56,0
91-180	25,1	79,0	0,0	0,0	64,0	10,1	15,0
>180	61,0	62,8	20,0	25,0	26,8	20,0	16,0
Total	811,7	956,7	348,4	276,2	268,0	195,2	340,4

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

*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	184	2389	2230	9	177	1899	2071	11	150	2803	2148
Intragruppo y off-shore***	0	0	1278	1184	0	0	1251	724	0	0	1246	1003
Otros	184	4	484	736	177	9	361	717	150	11	438	1335
Total	188	188	4150	4150	185	185	3512	3512	160	160	4487	4487

* 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.