

Fecha de Publicación: 8 de Febrero de 2012
 Fecha de Información: 06 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\$1472,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,9%.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	191,7	407,3	170,0	50,0	107,3	11,7	130,0
15-35	346,8	474,9	235,0	173,0	73,9	7,8	166,0
36-60	144,3	16,4	0,0	94,0	16,4	50,3	0,0
61-90	54,4	13,7	1,0	10,0	12,6	44,4	0,0
91-180	9,2	34,2	0,0	5,0	31,2	1,1	3,0
>180	76,0	7,9	0,0	20,0	2,9	51,0	5,0
Total	822,5	954,4	406,0	352,1	244,3	166,4	304,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,2 %	1,8 %	0,4 %	1,7 %
15-35	1,9 %	1,7 %	1,8 %	1,8 %
36-60	-	3,0 %	2,1 %	2,2 %
61-90	-	3,2 %	2,4 %	2,6 %
91-180	2,6 %	3,0 %	2,2 %	3,0 %
>180	2,4 %	3,2 %	2,5 %	2,5 %
Total	2,0 %	2,0 %	1,8 %	1,9 %

*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	6 al 10 de Febrero				13 al 17 de Febrero				20 al 24 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	205	2199	2476	13	150	2847	2345	6	183	1584	1967
Intragruppo y off-shore***	0	0	1410	772	0	2	1368	1006	0	0	1228	456
Otros	205	9	403	765	150	11	483	1346	183	6	261	651
Total	214	214	4013	4013	163	163	4698	4698	189	189	3073	3073

* 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.