

Fecha de Publicación: 16 de Febrero de 2012
 Fecha de Información: 14 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\$1384,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	201,3	331,2	283,5	129,0	25,2	49,8	22,5
15-35	337,1	382,7	267,3	222,3	26,9	26,4	88,5
36-60	55,0	28,1	15,0	0,0	13,1	55,0	0,0
61-90	32,4	52,8	30,0	0,0	12,8	22,4	10,0
91-180	5,1	9,7	0,0	0,0	9,7	5,1	0,0
>180	50,2	34,7	18,0	20,0	1,7	15,2	15,0
Total	681,2	839,2	613,8	371,3	89,4	173,9	136,0

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

*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	13 al 17 de Febrero				20 al 24 de Febrero				27 de Feb. al 2 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	166	3821	4332	12	186	1772	2295	8	289	2394	2121
Intragruppo y off-shore***	7	2	2210	1277	0	0	1439	534	0	0	980	1041
Otros	159	13	1025	1446	186	12	295	677	289	8	577	790
Total	181	181	7056	7056	197	197	3506	3506	297	297	3951	3951

* 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.