

Fecha de Publicación: 24 de Febrero de 2012
 Fecha de Información: 22 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\$1164,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	225,4	237,6	128,0	102,0	14,6	28,4	95,0
15-35	324,3	435,4	203,0	90,5	37,4	38,8	195,0
36-60	58,6	12,6	0,0	30,0	2,6	18,6	10,0
61-90	62,4	28,9	0,0	35,0	3,9	2,4	25,0
91-180	8,7	19,7	0,0	0,0	19,7	8,7	0,0
>180	48,6	32,5	25,0	25,0	2,5	18,6	5,0
Total	728,0	766,9	356,0	282,5	80,9	115,5	330,0

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

* 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	20 al 24 de Febrero				27 de Feb. al 2 de Marzo				5 al 9 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	194	2990	3101	10	310	2807	2627	4	116	1952	2254
Intragrupa y off-shore***	0	0	1680	1191	0	0	1274	1126	0	0	1078	753
Otros	194	13	331	709	310	10	690	1017	116	4	436	459
Total	207	207	5001	5001	320	320	4771	4771	120	120	3466	3466

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.