

Fecha de Publicación: 27 de Febrero de 2012
 Fecha de Información: 23 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\$1232,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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	170,6	90,8	62,0	125,5	13,8	30,1	15,0
15-35	245,4	571,1	482,5	126,3	45,6	76,1	43,0
36-60	5,0	3,8	0,0	0,0	3,8	5,0	0,0
61-90	45,8	15,0	0,0	0,0	15,0	45,8	0,0
91-180	30,1	47,8	0,0	5,0	37,8	15,1	10,0
>180	69,6	10,2	0,1	20,1	5,0	44,5	5,0
Total	566,4	738,6	544,6	276,9	121,0	216,5	73,0

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

* 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

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	189	3037	3095	10	306	2883	2647	4	120	2008	2323
Intragrupa y off-shore***	0	0	1680	1230	0	0	1279	1166	0	0	1135	800
Otros	189	13	325	718	306	10	695	1044	120	4	443	463
Total	202	202	5042	5042	316	316	4857	4857	124	124	3586	3586

* 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 intragrupo.