

Fecha de Publicación: 28 de Febrero de 2012
 Fecha de Información: 24 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\$1099,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	221,1	170,6	130,0	149,0	40,6	72,1	0,0
15-35	174,1	337,4	229,4	61,7	39,0	43,4	69,0
36-60	6,2	6,5	0,0	0,0	6,5	6,2	0,0
61-90	48,9	55,8	0,0	25,0	45,8	13,9	10,0
91-180	22,5	20,9	0,0	0,0	20,9	22,5	0,0
>180	56,0	84,0	0,0	20,0	59,0	11,0	25,0
Total	528,8	675,0	359,4	255,7	211,6	169,1	104,0

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

*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	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	184	3042	3097	10	306	3104	2739	4	121	2014	2400
Intragruppo y off-shore***	0	0	1680	1230	0	0	1359	1315	0	0	1185	800
Otros	184	13	327	722	306	10	706	1116	121	4	470	469
Total	196	196	5049	5049	316	316	5169	5169	125	125	3669	3669

* 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.