

Fecha de Publicación: 29 de Febrero de 2012
 Fecha de Información: 27 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\$1016,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.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	338,9	182,8	65,1	182,5	7,7	46,4	110,0
15-35	331,7	184,0	64,5	185,0	1,5	28,7	118,0
36-60	71,4	31,7	0,0	0,0	1,7	41,4	30,0
61-90	3,1	4,9	0,0	0,0	4,9	3,1	0,0
91-180	30,7	38,9	0,0	22,0	38,9	8,7	0,0
>180	17,5	47,3	34,0	5,0	5,3	4,5	8,0
Total	793,4	489,4	163,6	394,5	59,8	132,9	266,0

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

*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	27 de Feb. al 2 de Marzo				5 al 9 de Marzo				12 al 16 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	301	3169	2813	4	121	2220	2481	2	155	2116	2733
Intragruppo y off-shore***	0	0	1422	1355	0	0	1188	913	0	0	1659	882
Otros	301	11	698	1121	121	4	478	492	155	2	370	530
Total	312	312	5288	5288	125	125	3885	3885	158	158	4144	4144

* 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.