

Fecha de Publicación: 23 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 21 de Marzo 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\$915,5 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	204,6	132,8	89,0	84,0	41,8	118,6	2,0
15-35	170,9	242,4	187,4	85,0	17,0	47,9	38,0
36-60	34,2	16,2	10,0	3,0	6,2	31,2	0,0
61-90	23,3	4,0	0,0	0,0	4,0	23,3	0,0
91-180	47,2	10,7	0,0	20,0	5,7	22,2	5,0
>180	42,0	32,1	10,0	30,0	22,1	12,0	0,0
Total	522,2	438,3	296,4	222,0	96,9	255,2	45,0

* 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	4,9 %	1,8 %	1,4 %	1,6 %
15-35	5,0 %	4,0 %	3,7 %	4,0 %
36-60	-	5,0 %	4,3 %	4,5 %
61-90	-	5,1 %	4,3 %	4,4 %
91-180	4,2 %	4,7 %	4,2 %	4,2 %
>180	-	3,8 %	3,5 %	3,7 %
Total	4,9 %	3,0 %	2,8 %	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	19 al 23 de Marzo				26 al 30 de Marzo				2 al 6 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	110	2523	2863	20	222	3357	3116	0	56	1660	2006
Intragruppo y off-shore***	0	0	1569	992	0	0	1393	892	0	0	1153	772
Otros	110	15	526	763	222	20	660	1403	56	0	274	309
Total	125	125	4619	4619	241	241	5411	5411	56	56	3087	3087

* 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.