

Fecha de Publicación: 27 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 23 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\$1440,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	326,0	222,5	121,0	107,1	61,5	178,9	40,0
15-35	429,7	573,0	271,4	118,6	39,6	49,1	262,0
36-60	0,1	3,7	0,0	0,0	3,7	0,1	0,0
61-90	0,1	7,6	0,0	0,0	7,6	0,1	0,0
91-180	52,9	48,2	5,0	20,0	23,2	12,9	20,0
>180	69,4	73,9	5,0	24,3	23,9	0,1	45,0
Total	878,2	928,9	402,4	270,0	159,5	241,2	367,0

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

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**	14	111	2629	2915	21	225	3706	3317	0	56	1725	2186
Intragruppo y off-shore***	0	0	1619	992	0	0	1544	1021	0	0	1185	785
Otros	111	14	528	869	225	21	673	1585	56	0	402	340
Total	125	125	4776	4776	245	245	5923	5923	56	56	3312	3312

* 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.