

Fecha de Publicación: 29 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 27 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\$910,8 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	274,6	92,5	18,0	4,0	0,5	196,6	74,0
15-35	132,5	267,5	154,5	38,5	61,0	42,0	52,0
36-60	28,3	0,9	0,0	0,0	0,9	28,3	0,0
61-90	43,2	18,5	0,0	0,0	18,5	43,2	0,0
91-180	38,3	52,1	0,0	15,0	42,1	13,3	10,0
>180	60,6	57,7	2,5	40,0	35,2	0,6	20,0
Total	577,5	489,4	175,0	97,5	158,4	324,0	156,0

* 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	3,2 %	9,9 %	3,9 %	4,1 %
15-35	4,9 %	5,1 %	4,7 %	5,0 %
36-60	-	5,9 %	4,3 %	4,3 %
61-90	-	4,4 %	3,8 %	4,0 %
91-180	4,2 %	3,9 %	4,0 %	4,0 %
>180	3,6 %	3,9 %	3,6 %	3,7 %
Total	3,9 %	5,0 %	4,0 %	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	26 al 30 de Marzo				2 al 6 de Abril				9 al 13 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	220	4168	3770	0	56	1838	2237	11	124	2050	2236
Intragruppo y off-shore***	0	0	1702	1133	0	0	1185	799	0	0	1291	736
Otros	220	20	884	1851	56	0	403	390	124	11	454	823
Total	240	240	6754	6754	56	56	3426	3426	135	135	3795	3795

* 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.