

Fecha de Publicación: 11 de Abril de 2012
 Fecha de Información: 09 de Abril 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\$869,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.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	441,1	383,3	66,0	103,1	22,3	43,0	295,0
15-35	124,8	145,2	56,5	55,3	55,8	36,5	33,0
36-60	15,8	2,0	1,1	0,0	0,9	15,8	0,0
61-90	5,9	0,1	0,0	0,0	0,1	5,9	0,0
91-180	33,5	13,1	0,0	0,0	13,1	33,5	0,0
>180	30,1	32,9	0,0	0,0	2,9	0,1	30,0
Total	651,2	576,5	123,6	158,4	95,0	134,9	358,0

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

*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	9 al 13 de Abril				16 al 20 de Abril				23 al 27 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	115	3000	3049	40	96	1702	1996	10	163	2068	2751
Intragruppo y off-shore***	0	1	1601	1029	0	0	1172	359	0	0	1682	487
Otros	115	23	608	1131	96	40	381	900	163	10	370	881
Total	139	139	5209	5209	136	136	3255	3255	174	174	4120	4120

* 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.