

Fecha de Publicación: 16 de Abril de 2012
 Fecha de Información: 12 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\$1108,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,7%.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	129,8	213,1	62,8	56,5	141,4	64,3	9,0
15-35	279,9	399,1	248,3	114,0	53,8	68,9	97,0
36-60	44,0	9,6	0,0	20,0	9,6	24,0	0,0
61-90	17,9	17,2	0,0	0,0	17,2	17,9	0,0
91-180	47,5	34,5	0,0	15,0	9,5	7,5	25,0
>180	25,1	36,7	15,0	10,0	6,7	0,1	15,0
Total	544,3	710,2	326,0	215,5	238,2	182,8	146,0

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

*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**	25	103	3566	3282	43	102	2016	2240	11	167	2294	2987
Intragruppo y off-shore***	0	1	1699	1385	0	0	1250	466	0	0	1812	541
Otros	103	23	694	1292	102	43	490	1051	167	11	382	960
Total	128	128	5959	5959	145	145	3756	3756	178	178	4488	4488

* 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.