

Fecha de Publicación: 23 de Abril de 2012
 Fecha de Información: 19 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\$847,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	142,5	139,7	75,0	48,5	25,7	55,0	39,0
15-35	213,7	340,4	254,5	87,3	13,9	54,5	72,0
36-60	24,9	2,1	0,0	0,0	2,1	24,9	0,0
61-90	35,4	21,4	5,4	25,0	6,0	0,4	10,0
91-180	0,0	11,9	9,4	0,0	2,5	0,0	0,0
>180	25,0	11,1	10,0	0,0	1,1	25,0	0,0
Total	441,6	526,7	354,3	160,8	51,3	159,9	121,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6,5 %	5,3 %	5,4 %	5,5 %
15-35	5,7 %	5,5 %	5,3 %	5,5 %
36-60	-	7,5 %	5,4 %	5,5 %
61-90	3,0 %	5,0 %	2,5 %	3,2 %
91-180	-	4,9 %	-	4,9 %
>180	-	3,6 %	4,2 %	4,0 %
Total	5,7 %	5,4 %	5,0 %	5,3 %

*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	16 al 20 de Abril				23 al 27 de Abril				30 de Abr. al 4 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	41	112	2413	2657	10	171	2635	3394	11	65	1282	1431
Intragrupa y off-shore***	0	0	1562	723	0	0	2066	653	0	0	721	256
Otros	112	41	538	1133	171	10	448	1102	64	11	317	633
Total	153	153	4513	4513	180	180	5148	5148	75	75	2320	2320

* 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 intragrupo.