

Fecha de Publicación: 07 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 03 de Mayo 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\$1618,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.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	453,7	405,4	137,3	173,2	61,1	73,5	207,0
15-35	335,6	419,4	309,0	118,0	10,4	117,6	100,0
36-60	3,4	27,0	20,1	0,0	6,9	3,4	0,0
61-90	10,4	38,2	0,0	0,0	38,2	10,4	0,0
91-180	0,4	42,3	10,0	0,0	32,3	0,4	0,0
>180	71,1	128,4	0,0	60,0	118,4	1,1	10,0
Total	874,6	1060,5	476,4	351,2	267,1	206,4	317,0

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

*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	30 de Abr. al 4 de Mayo				7 al 11 de Mayo				14 al 18 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	51	1885	1985	129	112	3304	3853	211	142	2413	3084
Intragruppo y off-shore***	0	0	993	587	0	2	2031	870	0	0	1812	737
Otros	51	22	460	766	112	127	656	1268	141	211	472	875
Total	72	72	3338	3338	241	241	5992	5992	353	353	4697	4697

* 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.