

Fecha de Publicación: 09 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 07 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\$1401,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.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	305,0	304,6	142,5	141,4	33,1	34,6	129,0
15-35	370,9	365,5	249,5	103,1	20,0	171,8	96,0
36-60	145,9	97,1	30,0	0,0	6,1	84,9	61,0
61-90	1,3	7,1	0,0	0,0	7,1	1,3	0,0
91-180	12,8	24,8	0,0	0,0	14,8	2,8	10,0
>180	5,0	57,1	0,0	0,0	57,1	5,0	0,0
Total	840,8	856,2	422,0	244,5	138,2	300,3	296,0

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

*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	7 al 11 de Mayo				14 al 18 de Mayo				21 al 25 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	130	115	3962	4185	212	143	2541	3315	45	98	1371	1734
Intragruppo y off-shore***	0	2	2164	1301	0	0	1978	793	0	0	820	572
Otros	115	129	700	1340	143	212	472	884	98	45	491	377
Total	245	245	6826	6826	355	355	4992	4992	143	143	2683	2683

* 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.