

Fecha de Publicación: 10 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 08 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\$1693,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	467,1	466,1	91,0	103,0	55,1	44,1	320,0
15-35	448,0	538,4	320,9	68,0	38,5	201,0	179,0
36-60	32,5	60,6	55,0	0,0	5,6	32,5	0,0
61-90	5,6	26,7	0,0	0,0	26,6	5,4	0,2
91-180	88,9	71,9	25,0	45,0	6,9	3,9	40,0
>180	0,4	26,4	0,0	0,0	26,4	0,4	0,0
Total	1042,5	1190,2	491,9	216,0	159,2	287,4	539,2

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

*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	112	4189	4412	212	143	2733	3536	46	98	1468	1788
Intragrupo y off-shore***	0	2	2214	1373	0	0	2019	799	0	0	820	597
Otros	112	129	731	1350	143	212	497	915	98	46	506	408
Total	242	242	7135	7135	355	355	5250	5250	144	144	2794	2794

* 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.