

Fecha de Publicación: 14 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 10 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\$1350,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,3%.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	144,2	192,6	129,0	72,0	48,6	57,2	15,0
15-35	406,9	473,2	417,5	124,0	3,7	230,9	52,0
36-60	21,9	1,2	0,0	0,0	1,2	21,9	0,0
61-90	35,0	42,9	30,4	0,0	7,4	30,0	5,0
91-180	10,1	46,9	30,0	0,0	16,9	10,1	0,0
>180	28,0	22,3	4,0	0,0	15,3	25,0	3,0
Total	646,2	779,1	610,9	196,0	93,2	375,2	75,0

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

*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	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**	92	111	4365	4503	240	145	2921	3708	51	98	1572	1992
Intragrupa y off-shore***	0	2	2304	1518	0	0	2079	869	0	0	1006	600
Otros	111	90	733	1381	145	240	540	963	98	51	509	494
Total	203	203	7402	7402	385	385	5540	5540	150	150	3087	3087

* 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.