

Fecha de Publicación: 15 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 11 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\$1151,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.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	125,1	105,7	72,0	95,0	23,7	20,1	10,0
15-35	273,0	310,5	209,7	118,0	6,9	61,0	94,0
36-60	0,7	11,2	0,0	0,0	11,2	0,7	0,0
61-90	64,0	35,1	25,0	10,0	10,1	54,0	0,0
91-180	50,1	89,5	50,0	15,0	14,5	10,1	25,0
>180	45,0	190,6	123,1	25,0	47,4	0,0	20,0
Total	557,9	742,5	479,8	263,0	113,8	145,9	149,0

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

*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	4504	240	151	2983	3768	52	102	1635	2029
Intragruppo y off-shore***	0	2	2304	1518	0	0	2131	914	0	0	1026	650
Otros	111	90	733	1381	151	240	547	979	102	52	516	497
Total	203	203	7402	7402	390	390	5661	5661	154	154	3177	3177

* 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.