

Fecha de Publicación: 16 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 14 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\$1270,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,2%.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	286,6	346,0	232,4	121,0	16,6	68,6	97,0
15-35	296,3	411,8	301,3	57,9	24,1	151,9	86,5
36-60	32,5	7,3	0,0	0,0	2,3	27,5	5,0
61-90	0,9	9,3	0,0	0,0	9,3	0,9	0,0
91-180	7,7	38,9	20,0	0,0	18,9	7,7	0,0
>180	20,6	1,0	0,0	8,0	1,0	12,6	0,0
Total	644,5	814,3	553,7	186,9	72,1	269,1	188,5

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

*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	14 al 18 de Mayo				21 al 25 de Mayo				28 de May. al 1 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	234	154	3231	3993	53	117	1676	2131	7	92	1612	1555
Intragrupa y off-shore***	0	0	2277	1035	0	0	1113	650	0	0	953	508
Otros	154	234	544	1025	117	53	516	524	92	7	240	741
Total	387	387	6053	6053	170	170	3306	3306	99	99	2805	2805

* 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.