

Fecha de Publicación: 18 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 16 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\$2221,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.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	398,0	98,6	24,0	183,0	19,6	160,0	55,0
15-35	626,5	1066,4	810,0	175,6	1,9	196,4	254,5
36-60	11,3	7,5	0,0	0,0	7,5	11,3	0,0
61-90	8,9	3,0	0,0	0,7	3,0	8,2	0,0
91-180	27,2	133,9	90,0	0,1	33,9	17,1	10,0
>180	117,8	41,6	38,7	100,0	2,9	17,8	0,0
Total	1189,7	1351,0	962,7	459,4	68,8	410,8	319,5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,6 %	6,7 %	2,2 %	2,8 %
15-35	7,5 %	6,9 %	5,8 %	6,7 %
36-60	-	6,7 %	5,8 %	6,2 %
61-90	-	9,4 %	5,2 %	6,3 %
91-180	4,5 %	4,4 %	4,9 %	4,5 %
>180	-	6,6 %	4,5 %	4,7 %
Total	6,8 %	6,6 %	4,0 %	5,6 %

*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**	235	156	3530	4171	58	118	1957	2277	8	92	1800	1677
Intragruppo y off-shore***	0	0	2409	1283	0	0	1211	670	0	0	1036	509
Otros	156	235	545	1030	118	58	534	755	92	8	235	885
Total	391	391	6484	6484	176	176	3702	3702	100	100	3071	3071

* 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.