

Fecha de Publicación: 22 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 17 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\$2363,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,2%.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	425,0	316,8	116,3	212,5	90,5	102,5	110,0
15-35	652,7	1014,4	761,0	147,0	9,4	261,7	244,0
36-60	66,6	38,5	30,0	0,0	8,5	66,6	0,0
61-90	10,8	32,0	23,0	0,7	9,0	10,0	0,0
91-180	31,5	70,0	58,0	0,4	12,0	31,2	0,0
>180	48,9	20,7	0,0	12,1	10,2	26,2	10,6
Total	1235,4	1492,4	988,3	372,6	139,5	498,2	364,6

* 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	4,7 %	6,6 %	5,4 %	5,6 %
15-35	4,0 %	7,9 %	6,3 %	6,7 %
36-60	-	6,3 %	6,3 %	6,3 %
61-90	-	5,9 %	4,4 %	5,6 %
91-180	-	5,3 %	4,2 %	5,0 %
>180	4,6 %	4,0 %	4,1 %	4,2 %
Total	4,2 %	7,3 %	5,8 %	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**	219	159	3738	4185	59	120	2075	2459	9	92	1918	1791
Intragruppo y off-shore***	0	0	2429	1475	0	0	1265	690	0	0	1078	509
Otros	159	219	539	1046	120	59	622	813	92	9	237	933
Total	377	377	6707	6707	179	179	3962	3962	101	101	3234	3234

* 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.