

Fecha de Publicación: 23 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 18 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\$1603,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,8%.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	107,6	232,4	186,0	36,0	41,4	66,6	5,0
15-35	453,6	656,0	512,3	134,5	27,7	203,1	116,0
36-60	58,0	5,9	2,5	55,0	3,4	3,0	0,0
61-90	37,9	46,7	10,0	0,0	16,7	17,9	20,0
91-180	22,3	12,7	0,0	0,0	12,7	22,3	0,0
>180	95,5	35,5	3,3	40,0	12,3	35,5	20,0
Total	774,9	989,2	714,0	265,5	114,2	348,4	161,0

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

*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**	199	158	3738	4188	55	120	2159	2550	11	112	1940	1850
Intragruppo y off-shore***	0	0	2429	1475	0	0	1406	726	0	0	1123	509
Otros	158	199	542	1046	120	55	567	855	112	11	251	954
Total	357	357	6709	6709	175	175	4132	4132	123	123	3313	3313

* 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.