

Fecha de Publicación: 30 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 28 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\$229,6 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	35,9	31,2	16,1	16,1	15,1	19,8	0,0
15-35	67,3	41,4	16,0	36,0	15,4	21,3	10,0
36-60	3,1	3,4	0,0	0,0	3,4	3,1	0,0
61-90	0,1	5,3	0,0	0,0	5,3	0,1	0,0
91-180	21,3	5,9	0,0	0,0	5,9	21,3	0,0
>180	12,1	22,6	10,5	0,0	2,1	2,1	10,0
Total	139,8	109,7	42,6	52,1	47,1	67,7	20,0

* 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	-	3,6 %	3,7 %	3,6 %
15-35	5,8 %	6,1 %	5,4 %	5,7 %
36-60	-	5,7 %	5,5 %	5,6 %
61-90	-	5,1 %	3,5 %	5,1 %
91-180	-	5,3 %	4,5 %	4,7 %
>180	3,9 %	4,8 %	4,1 %	4,1 %
Total	4,9 %	5,3 %	4,8 %	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	28 de May. al 1 de Junio				4 al 8 de Junio				11 al 15 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	115	2560	2277	22	130	2600	3070	246	90	2466	3357
Intragruppo y off-shore***	0	0	1332	826	0	0	1718	689	0	0	2371	619
Otros	114	11	347	1136	130	22	536	1095	90	246	250	1110
Total	126	126	4240	4240	151	151	4854	4854	336	336	5087	5087

* 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.