

Fecha de Publicación: 10 de Abril de 2012
 Fecha de Información: 04 de Abril 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\$786,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.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	91,9	145,4	85,3	72,0	60,1	19,9	0,0
15-35	219,9	285,8	211,5	95,0	17,3	67,9	57,0
36-60	1,6	5,6	0,0	0,0	5,6	1,6	0,0
61-90	25,3	42,4	38,0	0,0	4,4	25,3	0,0
91-180	0,0	24,2	20,0	0,0	4,2	0,0	0,0
>180	0,4	1,2	0,0	0,0	1,2	0,4	0,0
Total	339,1	504,6	354,7	167,0	92,9	115,1	57,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	5,3 %	1,0 %	3,8 %
15-35	5,2 %	5,3 %	4,6 %	4,9 %
36-60	-	4,5 %	3,8 %	4,4 %
61-90	-	3,1 %	4,1 %	3,5 %
91-180	-	4,8 %	-	4,8 %
>180	-	2,3 %	3,2 %	2,6 %
Total	5,2 %	4,9 %	3,7 %	4,5 %

*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	2 al 6 de Abril				9 al 13 de Abril				16 al 20 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	50	2338	2403	24	120	2623	2737	40	94	1663	1938
Intragrupa y off-shore***	0	0	1198	1040	0	1	1579	926	0	0	1128	359
Otros	50	12	436	529	120	23	598	1137	94	40	382	875
Total	63	63	3972	3972	145	145	4800	4800	134	134	3173	3173

* 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.