

Fecha de Publicación: 26 de Abril de 2012
 Fecha de Información: 24 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\$894,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.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	139,4	90,6	38,0	68,0	32,6	51,4	20,0
15-35	125,2	255,7	195,9	42,7	5,8	28,5	54,0
36-60	38,1	8,0	0,0	2,4	8,0	35,7	0,0
61-90	38,2	13,9	0,0	0,0	13,9	38,2	0,0
91-180	101,7	80,9	0,0	40,0	50,9	31,7	30,0
>180	73,9	55,3	29,3	50,0	3,5	1,4	22,5
Total	516,6	504,4	263,2	203,1	114,7	187,0	126,5

* 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	2,8 %	6,0 %	4,3 %	4,7 %
15-35	3,6 %	4,2 %	5,6 %	4,4 %
36-60	-	6,1 %	5,3 %	5,5 %
61-90	-	5,6 %	4,8 %	5,0 %
91-180	3,4 %	4,8 %	3,8 %	4,1 %
>180	4,5 %	4,2 %	3,0 %	3,7 %
Total	3,6 %	4,7 %	4,5 %	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	23 al 27 de Abril				30 de Abr. al 4 de Mayo				7 al 11 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	171	3381	3778	13	67	1502	1594	112	103	2546	3033
Intragruppo y off-shore***	0	0	2244	1246	0	0	788	347	0	0	1719	685
Otros	171	11	466	1067	67	13	355	704	103	112	507	1054
Total	182	182	6091	6091	80	80	2646	2646	215	215	4773	4773

* 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.