

Fecha de Publicación: 30 de Abril de 2012
 Fecha de Información: 26 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\$1231,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.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	306,8	164,4	21,0	235,0	121,4	49,8	22,0
15-35	344,7	282,0	143,0	107,0	23,0	121,7	116,0
36-60	15,9	91,9	88,0	5,0	3,9	10,9	0,0
61-90	3,1	12,2	0,0	0,0	12,2	3,1	0,0
91-180	50,8	31,9	0,0	0,0	31,9	50,8	0,0
>180	59,5	5,8	0,0	15,0	5,8	44,5	0,0
Total	780,8	588,3	252,0	362,0	198,3	280,8	138,0

* 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	3,1 %	5,3 %	3,5 %	4,0 %
15-35	5,3 %	5,6 %	4,4 %	4,9 %
36-60	-	5,4 %	5,1 %	5,4 %
61-90	-	5,1 %	4,8 %	5,1 %
91-180	-	4,5 %	4,9 %	4,7 %
>180	-	4,4 %	4,1 %	4,1 %
Total	4,9 %	5,3 %	4,0 %	4,6 %

*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**	9	174	3708	3854	14	69	1613	1659	114	106	2694	3190
Intragrupa y off-shore***	0	0	2311	1561	0	0	811	409	0	0	1768	685
Otros	174	9	468	1072	69	14	361	717	106	114	562	1150
Total	183	183	6486	6486	83	83	2785	2785	220	220	5024	5024

* 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.