

Fecha de Publicación: 30 de Marzo de 2012
 Fecha de Información: 28 de Marzo 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\$1496,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.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	397,3	167,9	23,5	205,5	113,4	160,8	31,0
15-35	311,1	550,1	399,4	105,0	84,7	140,1	66,0
36-60	59,2	31,0	0,0	0,0	6,0	34,2	25,0
61-90	25,3	36,4	10,0	0,0	26,4	25,3	0,0
91-180	14,3	18,9	0,0	10,0	18,9	4,3	0,0
>180	4,8	1,6	0,0	3,0	1,6	1,8	0,0
Total	812,1	805,9	432,9	323,5	251,0	366,6	122,0

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

*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	26 al 30 de Marzo				2 al 6 de Abril				9 al 13 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	221	4511	3891	2	57	1883	2255	11	122	2110	2309
Intragruppo y off-shore***	0	0	1705	1338	0	0	1185	799	0	0	1331	736
Otros	221	20	988	1975	57	2	403	417	122	11	487	883
Total	241	241	7204	7204	59	59	3471	3471	133	133	3927	3927

* 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.