

Fecha de Publicación: 02 de Abril de 2012
 Fecha de Información: 29 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\$1453,3 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	290,1	137,9	53,3	90,0	32,7	148,1	52,0
15-35	289,4	626,5	471,3	66,4	30,2	98,1	125,0
36-60	87,3	25,1	20,0	0,0	5,1	87,3	0,0
61-90	21,7	18,4	5,0	0,1	4,4	12,6	9,0
91-180	31,2	39,9	5,0	5,1	14,9	6,2	20,0
>180	53,6	48,2	24,8	30,0	13,4	13,6	10,0
Total	773,3	896,0	579,3	191,5	100,7	365,8	216,0

* 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	4,1 %	3,8 %	4,2 %	4,1 %
15-35	4,6 %	5,1 %	4,6 %	4,9 %
36-60	-	4,8 %	4,4 %	4,5 %
61-90	4,3 %	4,7 %	3,7 %	4,1 %
91-180	4,3 %	4,4 %	3,6 %	4,2 %
>180	3,8 %	4,0 %	3,2 %	3,7 %
Total	4,4 %	4,8 %	4,3 %	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	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**	19	218	4604	3943	12	55	1952	2332	11	124	2240	2341
Intragruppo y off-shore***	0	0	1744	1395	0	0	1195	807	0	0	1361	761
Otros	218	19	997	2007	55	12	423	431	124	11	488	987
Total	237	237	7345	7345	67	67	3570	3570	135	135	4089	4089

* 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.