

Fecha de Publicación: 03 de Abril de 2012
 Fecha de Información: 30 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\$870,3 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	223,6	46,3	10,0	63,0	19,3	143,6	17,0
15-35	170,8	331,1	236,4	79,3	56,7	53,6	38,0
36-60	17,2	3,6	0,0	0,0	3,6	17,2	0,0
61-90	22,1	59,7	0,0	5,0	59,7	17,1	0,0
91-180	14,2	12,8	0,0	10,0	12,8	4,2	0,0
>180	13,5	10,4	0,0	6,5	10,4	7,0	0,0
Total	461,4	463,9	246,4	163,8	162,4	242,6	55,0

* 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	5,6 %	4,6 %	3,6 %	3,9 %
15-35	4,2 %	5,2 %	4,1 %	4,8 %
36-60	-	4,8 %	4,7 %	4,7 %
61-90	-	4,7 %	4,0 %	4,5 %
91-180	-	4,2 %	3,9 %	4,1 %
>180	-	3,8 %	3,5 %	3,6 %
Total	4,7 %	5,0 %	3,9 %	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	208	4605	3943	12	48	2070	2348	13	126	2343	2378
Intragruppo y off-shore***	0	0	1744	1395	0	0	1198	868	0	0	1368	763
Otros	208	19	997	2007	48	12	436	488	126	13	502	1071
Total	227	227	7345	7345	60	60	3704	3704	139	139	4212	4212

* 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.