

Fecha de Publicación: 04 de Abril de 2012
 Fecha de Información: 02 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\$1079,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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	420,4	136,6	41,0	253,5	39,1	110,4	56,5
15-35	189,1	327,7	220,2	93,5	31,5	19,6	76,0
36-60	1,5	33,8	25,0	0,4	8,8	1,1	0,0
61-90	26,3	36,0	5,0	10,4	21,0	5,9	10,0
91-180	8,1	31,1	0,0	0,0	31,1	8,1	0,0
>180	1,0	10,7	0,0	0,0	10,7	1,0	0,0
Total	646,2	576,0	291,2	357,8	142,2	146,0	142,5

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,7 %	3,6 %	3,0 %	3,3 %
15-35	3,8 %	4,8 %	4,8 %	4,6 %
36-60	-	4,6 %	3,8 %	4,6 %
61-90	4,2 %	3,8 %	3,9 %	3,9 %
91-180	-	3,8 %	3,9 %	3,8 %
>180	-	4,3 %	2,9 %	4,2 %
Total	4,2 %	4,4 %	3,4 %	3,9 %

*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	2 al 6 de Abril				9 al 13 de Abril				16 al 20 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	50	2318	2392	19	126	2495	2459	38	89	1588	1880
Intragrupa y off-shore***	0	0	1198	1030	0	0	1409	854	0	0	1128	359
Otros	50	12	436	529	126	19	530	1121	89	38	355	832
Total	62	62	3951	3951	145	145	4434	4434	127	127	3071	3071

* 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.