

Fecha de Publicación: 13 de Abril de 2012
 Fecha de Información: 11 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\$1864,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	671,8	218,7	128,8	384,5	26,9	224,3	63,0
15-35	332,9	642,0	416,5	73,0	26,5	60,9	199,0
36-60	36,6	42,6	40,0	35,0	2,6	1,6	0,0
61-90	65,4	3,5	0,0	0,0	3,5	65,4	0,0
91-180	46,9	41,0	0,0	45,0	41,0	1,9	0,0
>180	20,1	20,3	0,0	5,0	5,3	0,1	15,0
Total	1173,7	968,1	585,3	542,5	105,9	354,2	277,0

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

*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	9 al 13 de Abril				16 al 20 de Abril				23 al 27 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	104	3471	3196	40	102	1986	2180	11	165	2277	2921
Intragruppo y off-shore***	0	1	1699	1345	0	0	1247	451	0	0	1752	527
Otros	104	23	608	1237	102	40	442	1044	165	11	375	956
Total	128	128	5777	5777	142	142	3675	3675	176	176	4404	4404

* 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.