

Fecha de Publicación: 25 de Abril de 2012
 Fecha de Información: 23 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\$741,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,9%.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	236,9	142,3	50,0	129,0	16,3	32,0	76,0
15-35	215,5	209,7	139,8	105,0	10,0	50,6	60,0
36-60	4,0	3,2	0,0	0,0	3,2	4,0	0,0
61-90	0,2	6,7	1,0	0,0	5,7	0,2	0,0
91-180	14,8	14,6	0,0	10,0	14,6	4,8	0,0
>180	6,0	23,3	0,0	0,0	23,3	6,0	0,0
Total	477,4	399,8	190,8	243,9	73,1	97,5	136,0

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

*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	23 al 27 de Abril				30 de Abr. al 4 de Mayo				7 al 11 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	146	3371	3768	12	67	1414	1544	112	104	2531	3024
Intragruppo y off-shore***	0	0	2222	1218	0	0	772	307	0	0	1719	685
Otros	146	12	488	1094	67	12	331	665	104	112	497	1039
Total	157	157	6081	6081	79	79	2517	2517	216	216	4747	4747

* 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.