

Fecha de Publicación: 02 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 27 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\$847,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,7%.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	124,1	249,3	154,3	60,0	69,0	38,1	26,0
15-35	196,3	166,4	129,0	41,1	12,4	130,3	25,0
36-60	28,5	10,1	0,0	0,0	10,1	28,5	0,0
61-90	0,0	13,0	0,0	0,0	13,0	0,0	0,0
91-180	35,5	49,8	0,0	0,0	44,8	30,5	5,0
>180	11,6	18,8	1,0	0,0	17,8	11,6	0,0
Total	396,1	507,5	284,3	101,1	167,2	239,1	56,0

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

*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**	10	172	3708	3854	19	65	1700	1862	114	107	2726	3238
Intragruppo y off-shore***	0	0	2311	1561	0	0	950	469	0	0	1783	685
Otros	172	10	468	1072	65	19	409	728	107	114	585	1172
Total	182	182	6486	6486	84	84	3059	3059	221	221	5095	5095

* 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.