

Fecha de Publicación: 04 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 02 de Mayo 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\$1223,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.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	339,9	328,0	96,1	81,7	63,9	90,2	168,0
15-35	349,1	195,8	124,3	130,7	12,9	159,8	58,6
36-60	31,6	98,5	0,0	5,0	73,5	1,6	25,0
61-90	6,0	9,9	0,0	0,0	9,9	6,0	0,0
91-180	30,0	15,4	0,0	10,0	15,4	20,0	0,0
>180	58,1	43,4	7,6	22,6	5,3	5,0	30,5
Total	814,8	690,8	228,0	250,0	180,8	282,7	282,1

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

*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	30 de Abr. al 4 de Mayo				7 al 11 de Mayo				14 al 18 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	51	1868	1971	126	109	3013	3548	211	140	2270	3008
Intragruppo y off-shore***	0	0	993	572	0	2	1898	757	0	0	1808	692
Otros	51	22	445	764	109	124	624	1230	140	211	467	845
Total	73	73	3306	3306	234	234	5535	5535	352	352	4546	4546

* 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.