

Fecha de Publicación: 11 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 09 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\$1227,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.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	256,7	257,5	183,0	143,0	4,5	43,7	70,0
15-35	289,6	427,9	328,3	96,0	28,6	122,6	71,0
36-60	15,2	5,4	0,0	0,0	5,4	15,2	0,0
61-90	29,1	4,9	0,0	0,0	4,9	29,1	0,0
91-180	40,8	34,7	0,0	20,0	24,7	10,8	10,0
>180	4,8	12,2	9,0	0,0	3,2	4,8	0,0
Total	636,1	742,6	520,3	259,0	71,3	226,1	151,0

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

*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	7 al 11 de Mayo				14 al 18 de Mayo				21 al 25 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	91	112	4346	4462	212	144	2841	3602	50	98	1544	1940
Intragruppo y off-shore***	0	2	2267	1498	0	0	2029	817	0	0	954	600
Otros	112	89	729	1382	143	212	498	949	98	50	508	467
Total	203	203	7342	7342	355	355	5368	5368	148	148	3007	3007

* 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.