

Fecha de Publicación: 25 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 23 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\$1497,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	296,6	188,3	36,1	84,5	21,2	81,1	131,0
15-35	310,3	543,6	336,6	121,0	143,0	125,3	64,0
36-60	59,6	13,0	0,0	0,0	13,0	59,6	0,0
61-90	46,9	21,2	10,7	0,0	10,5	46,9	0,0
91-180	17,2	10,3	0,1	0,0	10,2	17,2	0,0
>180	180,3	40,4	0,0	40,0	5,4	105,3	35,0
Total	910,8	816,9	383,6	245,5	203,3	435,3	230,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,2 %	5,2 %	5,6 %	5,4 %
15-35	5,1 %	7,2 %	6,6 %	6,8 %
36-60	-	6,8 %	6,4 %	6,5 %
61-90	-	5,9 %	5,8 %	5,8 %
91-180	-	5,3 %	5,0 %	5,1 %
>180	4,7 %	4,4 %	4,5 %	4,6 %
Total	5,1 %	6,9 %	5,8 %	6,1 %

*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	21 al 25 de Mayo				28 de May. al 1 de Junio				4 al 8 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	57	114	2577	2860	10	113	2118	2053	21	130	2509	2927
Intragrupa y off-shore***	0	0	1541	962	0	0	1207	513	0	0	1656	664
Otros	114	57	593	888	113	10	288	1047	130	21	455	1029
Total	170	170	4710	4710	123	123	3613	3613	151	151	4619	4619

* 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 intragrupo.