

Fecha de Publicación: 29 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 25 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\$1193,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,4%.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	393,6	186,4	151,9	318,8	19,5	59,8	15,0
15-35	134,9	292,2	242,2	78,1	10,0	16,8	40,0
36-60	26,5	27,5	0,0	0,0	27,5	26,5	0,0
61-90	7,0	31,0	22,0	0,0	9,0	7,0	0,0
91-180	37,4	23,3	0,0	0,0	23,3	37,4	0,0
>180	82,7	6,0	0,0	0,0	6,0	82,7	0,0
Total	682,1	566,3	416,1	396,9	95,3	230,2	55,0

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

*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	118	2599	2888	10	113	2550	2238	21	130	2588	3070
Intragruppo y off-shore***	0	0	1567	984	0	0	1316	810	0	0	1718	689
Otros	118	57	595	888	113	10	324	1142	130	21	536	1083
Total	174	174	4760	4760	123	123	4190	4190	151	151	4842	4842

* 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.