

Fecha de Publicación: 31 de Mayo de 2012
 Fecha de Información: 29 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\$1556,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.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	398,4	332,8	150,0	258,4	111,7	68,9	71,1
15-35	501,8	197,6	142,0	289,0	9,6	166,9	46,0
36-60	40,8	9,8	0,0	0,0	9,8	40,8	0,0
61-90	11,7	30,2	0,3	0,0	29,9	11,7	0,0
91-180	9,5	39,9	12,0	0,0	27,9	9,5	0,0
>180	4,3	96,3	85,0	0,0	11,3	4,3	0,0
Total	966,5	706,7	389,3	547,4	200,3	302,1	117,1

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

*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	28 de May. al 1 de Junio				4 al 8 de Junio				11 al 15 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	108	2755	2438	22	122	2652	3198	246	91	2653	3393
Intragruppo y off-shore***	0	0	1387	968	0	0	1813	709	0	0	2371	715
Otros	108	11	428	1164	122	22	558	1116	90	246	251	1166
Total	119	119	4570	4570	144	144	5024	5024	336	336	5274	5274

* 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.