

Fecha de Publicación: 1 de Junio de 2012
 Fecha de Información: 30 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\$1794,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	555,5	177,4	23,0	390,5	30,4	41,0	124,0
15-35	334,0	714,8	625,6	155,9	28,2	117,1	61,0
36-60	31,5	29,5	0,0	0,0	4,5	6,5	25,0
61-90	30,4	34,9	15,0	15,0	4,9	0,4	15,0
91-180	29,9	34,6	20,0	20,0	14,6	9,9	0,0
>180	10,1	41,8	30,0	0,0	6,8	5,1	5,0
Total	991,4	1032,9	713,6	581,4	89,3	180,0	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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,5 %	3,0 %	2,1 %	2,3 %
15-35	5,9 %	5,1 %	4,6 %	5,1 %
36-60	1,2 %	5,3 %	3,9 %	2,2 %
61-90	5,0 %	4,7 %	4,9 %	4,9 %
91-180	-	4,9 %	4,3 %	4,5 %
>180	4,1 %	4,1 %	3,5 %	4,0 %
Total	3,5 %	4,9 %	3,2 %	4,0 %

*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**	10	109	3206	2565	23	123	2695	3245	246	90	2708	3461
Intragruppo y off-shore***	0	0	1387	1299	0	0	1836	729	0	0	2422	755
Otros	109	10	431	1160	123	23	582	1139	90	246	267	1181
Total	119	119	5024	5024	145	145	5113	5113	337	337	5397	5397

* 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.