

Fecha de Publicación: 04 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 29 de Junio 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\$1425,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,9%.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	199,6	370,1	228,0	8,0	53,5	103,0	88,6
15-35	342,6	595,1	407,3	23,0	45,8	177,6	142,0
36-60	1,1	4,4	0,0	0,0	4,4	1,1	0,0
61-90	23,7	38,6	4,4	0,0	29,2	18,7	5,0
91-180	16,7	68,3	6,0	0,0	47,3	1,7	15,0
>180	8,9	7,1	0,4	8,0	6,7	0,9	0,0
Total	592,6	1083,6	646,1	39,0	187,0	303,0	250,6

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

*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	25 al 29 de Junio				2 al 6 de Julio				9 al 13 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	72	93	3966	4403	88	58	1677	2011	52	100	2501	2896
Intragruppo y off-shore***	0	0	2881	1967	0	0	1188	387	10	0	1986	832
Otros	93	72	690	1168	58	88	303	770	90	52	335	1094
Total	164	164	7537	7537	146	146	3168	3168	153	153	4822	4822

* 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.