

Fecha de Publicación: 14 de Junio de 2012
 Fecha de Información: 12 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\$1342,4 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	205,3	274,0	171,5	125,0	72,4	50,2	30,1
15-35	317,1	237,0	200,0	160,3	6,0	125,8	31,0
36-60	91,1	75,4	70,0	0,0	5,4	91,1	0,0
61-90	27,2	19,3	0,7	0,0	18,5	27,2	0,0
91-180	28,8	60,7	20,0	0,0	15,7	3,8	25,0
>180	58,0	34,7	26,3	10,0	8,4	48,0	0,0
Total	727,5	701,1	488,5	295,3	126,5	346,1	86,1

* 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	5,8 %	5,6 %	6,1 %	5,8 %
15-35	6,0 %	5,4 %	5,5 %	5,5 %
36-60	-	4,8 %	5,4 %	5,2 %
61-90	-	5,6 %	5,0 %	5,2 %
91-180	5,0 %	5,0 %	4,5 %	5,0 %
>180	-	4,9 %	4,3 %	4,4 %
Total	5,6 %	5,4 %	5,5 %	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	11 al 15 de Junio				18 al 22 de Junio				25 al 29 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	253	88	3877	4593	78	71	2226	2870	63	84	2656	3242
Intragruppo y off-shore***	3	1	2890	1433	0	0	2174	886	0	0	2231	1278
Otros	85	251	624	1364	71	78	361	1005	84	63	496	864
Total	341	341	7390	7390	149	149	4760	4760	147	147	5384	5384

* 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.