

Fecha de Publicación: 26 de Junio de 2012
 Fecha de Información: 22 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\$1236,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,8%.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	224,9	202,7	46,0	29,0	21,7	60,9	135,0
15-35	354,6	483,7	365,3	89,5	19,5	166,1	99,0
36-60	38,1	1,6	0,0	0,0	1,6	38,1	0,0
61-90	70,8	9,5	0,0	20,0	9,5	50,8	0,0
91-180	4,3	25,9	6,5	0,0	19,4	4,3	0,0
>180	12,6	41,7	36,5	10,0	5,2	2,6	0,0
Total	705,2	765,1	454,3	148,5	76,9	322,7	234,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,0 %	5,5 %	4,8 %	4,5 %
15-35	5,9 %	6,7 %	6,3 %	6,4 %
36-60	-	6,8 %	6,2 %	6,2 %
61-90	-	6,2 %	5,7 %	5,7 %
91-180	-	5,6 %	4,8 %	5,4 %
>180	-	3,3 %	4,0 %	3,5 %
Total	4,8 %	6,3 %	5,8 %	5,8 %

*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	18 al 22 de Junio				25 al 29 de Junio				2 al 6 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	68	92	3563	3471	70	96	3401	4003	85	55	1240	1594
Intragruppo y off-shore***	0	0	2300	1759	0	0	2627	1526	0	0	1104	376
Otros	92	68	530	1162	96	70	639	1138	55	85	190	564
Total	161	161	6392	6392	166	166	6667	6667	140	140	2534	2534

* 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 intragrupo.