

Fecha de Publicación: 27 de Junio de 2012
 Fecha de Información: 25 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\$1423,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,0%.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	358,8	333,2	156,9	96,4	16,3	102,4	160,0
15-35	315,9	375,7	265,5	149,0	59,2	115,9	51,0
36-60	56,0	6,5	0,0	0,0	6,2	55,7	0,3
61-90	6,4	0,0	0,0	0,0	0,0	6,4	0,0
91-180	127,5	28,9	0,1	0,0	13,8	112,5	15,0
>180	8,6	31,8	20,0	0,0	11,8	8,6	0,0
Total	873,2	776,1	442,5	245,4	107,3	401,5	226,3

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

*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	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**	70	99	3545	4156	86	56	1368	1725	50	98	1923	2374
Intragruppo y off-shore***	0	0	2723	1609	0	0	1165	376	10	0	1729	690
Otros	99	70	651	1154	56	86	190	623	88	50	298	886
Total	169	169	6918	6918	142	142	2724	2724	149	149	3950	3950

* 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.