

Fecha de Publicación: 5 de Junio de 2012
 Fecha de Información: 01 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\$1021,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.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	208,7	252,1	154,2	60,3	47,9	98,4	50,0
15-35	313,9	265,6	210,4	231,4	11,2	38,5	44,0
36-60	4,6	0,7	0,0	0,0	0,7	4,6	0,0
61-90	2,7	2,2	0,0	0,0	2,2	2,7	0,0
91-180	4,8	16,4	10,0	0,1	6,4	4,7	0,0
>180	5,5	37,9	30,0	0,0	7,9	5,5	0,0
Total	540,1	574,9	404,6	291,7	76,3	154,4	94,0

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

*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	103	3211	2575	32	116	2890	3450	252	92	2905	3703
Intragruppo y off-shore***	0	0	1397	1304	0	0	1962	789	0	0	2513	766
Otros	103	10	431	1160	116	32	631	1245	92	252	291	1240
Total	113	113	5039	5039	148	148	5484	5484	344	344	5709	5709

* 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.