

Fecha de Publicación: 09 de Junio de 2012
 Fecha de Información: 07 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\$1840,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	464,2	375,6	147,0	311,7	131,5	55,5	97,0
15-35	402,6	567,3	440,7	126,0	22,6	172,6	104,0
36-60	34,1	15,0	0,0	0,0	14,9	34,0	0,1
61-90	0,9	35,7	15,8	0,0	19,9	0,9	0,0
91-180	12,2	75,8	10,0	3,0	57,7	1,1	8,1
>180	5,3	65,8	35,0	0,0	25,8	0,3	5,0
Total	919,3	1135,1	648,5	440,7	272,4	264,4	214,2

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

*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	4 al 8 de Junio				11 al 15 de Junio				18 al 22 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	101	3594	3776	254	99	3641	4412	75	71	2088	2685
Intragrupa y off-shore***	0	0	2103	1342	3	1	2786	1253	0	0	2093	805
Otros	101	36	754	1333	96	253	564	1326	71	75	277	968
Total	136	136	6451	6451	353	353	6990	6990	147	147	4458	4458

* 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.