

Fecha de Publicación: 13 de Junio de 2012
 Fecha de Información: 08 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\$894,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.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	195,2	93,9	14,0	151,6	73,0	36,7	7,0
15-35	166,9	320,8	270,0	84,0	23,7	55,9	27,0
36-60	15,4	7,5	0,0	0,0	7,5	15,4	0,0
61-90	0,5	11,3	0,0	0,0	11,3	0,5	0,0
91-180	22,1	68,0	41,2	0,0	16,8	12,1	10,0
>180	24,0	12,8	5,2	24,0	7,6	0,0	0,0
Total	424,1	514,2	330,4	259,6	139,8	120,5	44,0

* 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	12,7 %	6,6 %	4,7 %	5,5 %
15-35	5,3 %	5,8 %	4,5 %	5,4 %
36-60	-	4,7 %	5,4 %	5,2 %
61-90	-	4,9 %	3,6 %	4,9 %
91-180	4,8 %	4,7 %	4,5 %	4,7 %
>180	-	4,6 %	4,1 %	4,3 %
Total	6,4 %	5,8 %	4,6 %	5,3 %

*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	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	87	3594	3767	252	91	3818	4479	76	71	2108	2716
Intragruppo y off-shore***	0	0	2103	1342	3	1	2786	1389	0	0	2107	820
Otros	87	36	745	1333	88	251	624	1359	71	76	294	973
Total	123	123	6441	6441	343	343	7227	7227	146	146	4509	4509

* 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.