

Fecha de Publicación: 19 de Junio de 2012
 Fecha de Información: 14 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\$2054,6 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	473,0	239,8	129,5	364,0	90,3	89,0	20,0
15-35	317,5	806,0	766,8	139,0	13,3	152,5	26,0
36-60	54,6	1,0	0,0	0,0	1,0	54,6	0,0
61-90	10,3	56,3	30,0	0,0	26,3	10,3	0,0
91-180	28,1	75,8	50,0	10,0	25,8	18,1	0,0
>180	5,0	38,3	30,0	0,0	3,3	0,0	5,0
Total	888,5	1217,1	1006,3	513,0	159,9	324,5	51,0

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

Sector	11 al 15 de Junio				18 al 22 de Junio				25 al 29 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	256	91	4455	4629	77	85	2419	3057	62	89	2788	3420
Intragruppo y off-shore***	3	1	2915	1986	0	0	2279	992	0	0	2335	1289
Otros	88	254	626	1381	84	77	414	1063	89	62	529	944
Total	347	347	7996	7996	162	162	5112	5112	151	151	5653	5653

* 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.