

Fecha de Publicación: 20 de Junio de 2012
 Fecha de Información: 15 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\$1806,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,2%.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	519,3	346,6	134,1	250,0	19,5	76,3	193,0
15-35	461,3	552,4	373,0	193,8	58,4	146,5	121,0
36-60	22,3	62,6	57,0	0,0	5,6	22,3	0,0
61-90	17,0	39,5	5,0	0,0	34,5	17,0	0,0
91-180	37,6	28,5	0,7	0,0	22,9	32,6	5,0
>180	27,2	10,9	5,0	10,0	5,9	17,2	0,0
Total	1084,6	1040,5	574,8	453,8	146,8	311,8	319,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,6 %	5,7 %	3,7 %	4,2 %
15-35	6,5 %	6,1 %	5,5 %	5,9 %
36-60	-	6,0 %	5,6 %	5,7 %
61-90	-	5,5 %	5,2 %	5,4 %
91-180	5,6 %	5,1 %	5,1 %	5,1 %
>180	-	5,1 %	4,5 %	4,6 %
Total	4,8 %	5,9 %	4,9 %	5,2 %

*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	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**	246	87	4467	4628	77	90	2709	3234	67	89	3008	3585
Intragrupa y off-shore***	3	1	2915	1986	0	0	2289	1061	0	0	2459	1470
Otros	84	244	625	1393	90	77	416	1118	89	67	542	954
Total	333	333	8008	8008	167	167	5413	5413	156	156	6009	6009

* 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.