

Fecha de Publicación: 22 de Junio de 2012
 Fecha de Información: 20 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 5,1%.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	506,9	148,0	65,0	388,5	60,0	95,4	23,0
15-35	396,0	686,1	530,5	115,4	9,6	134,6	146,0
36-60	29,9	32,7	20,0	0,0	12,7	29,9	0,0
61-90	16,5	18,9	0,0	0,0	8,9	6,5	10,0
91-180	83,5	12,4	1,9	20,0	10,4	63,5	0,1
>180	50,6	57,8	10,0	20,0	27,8	10,6	20,0
Total	1083,4	955,9	627,4	543,9	129,4	340,4	199,1

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

*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	18 al 22 de Junio				25 al 29 de Junio				2 al 6 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	68	89	3554	3430	68	91	3201	3712	84	55	1113	1523
Intragruppo y off-shore***	0	0	2297	1759	0	0	2516	1496	0	0	1041	357
Otros	89	68	495	1157	91	68	609	1119	55	84	187	462
Total	157	157	6345	6345	159	159	6326	6326	139	139	2341	2341

* 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.