

Fecha de Publicación: 03 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 28 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\$1301,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,8%.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	214,5	172,4	64,5	47,5	26,9	86,0	81,0
15-35	209,6	572,3	522,0	50,0	11,3	120,6	39,0
36-60	12,8	11,6	0,0	0,0	1,6	2,8	10,0
61-90	57,6	59,9	15,0	0,0	34,9	47,6	10,0
91-180	43,6	9,2	0,0	0,0	9,2	43,6	0,0
>180	30,5	47,7	10,0	25,0	37,7	5,5	0,0
Total	568,6	873,1	611,5	122,5	121,6	306,1	140,0

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

*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	25 al 29 de Junio				2 al 6 de Julio				9 al 13 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	72	94	3921	4357	88	57	1630	1929	51	98	2395	2650
Intragruppo y off-shore***	0	0	2836	1922	0	0	1181	402	10	0	1810	854
Otros	94	72	689	1168	57	88	272	751	88	51	310	1012
Total	165	165	7446	7446	144	144	3082	3082	149	149	4515	4515

* 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.