

Fecha de Publicación: 6 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 04 de Julio 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\$439,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,6%.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	190,9	0,8	0,0	184,4	0,8	6,5	0,0
15-35	33,3	203,5	199,0	0,0	4,5	33,3	0,0
36-60	0,0	1,2	0,0	0,0	1,2	0,0	0,0
61-90	0,0	1,0	0,0	0,0	1,0	0,0	0,0
91-180	1,5	4,9	0,0	0,0	4,9	1,5	0,0
>180	0,0	2,7	0,0	0,0	2,7	0,0	0,0
Total	225,8	214,1	199,0	184,4	15,1	41,4	0,0

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

*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	2 al 6 de Julio				9 al 13 de Julio				16 al 20 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	94	60	1984	2033	60	100	2610	2993	187	84	2262	3009
Intragruppo y off-shore***	0	0	1188	675	10	0	2034	862	0	0	2185	949
Otros	60	94	302	765	90	60	338	1128	84	187	298	787
Total	155	155	3474	3474	160	160	4982	4982	271	271	4745	4745

* 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.