

Fecha de Publicación: 12 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 10 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\$1129,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.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	372,9	295,0	49,0	138,5	36,0	24,4	210,0
15-35	237,8	303,7	228,6	36,0	8,1	134,8	67,0
36-60	76,6	7,3	5,0	0,0	2,3	76,6	0,0
61-90	20,3	9,5	0,0	0,0	9,5	20,3	0,0
91-180	15,1	12,9	0,0	0,0	12,9	15,1	0,0
>180	30,3	30,1	15,0	10,0	10,1	15,3	5,0
Total	753,1	658,5	297,6	184,5	78,9	286,6	282,0

* Cifras en millones de dólares

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

*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

Sectores	9 al 13 de Julio				16 al 20 de Julio				23 al 27 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	62	115	3348	3361	192	88	2671	3408	154	70	2564	2869
Intragrupa y off-shore***	10	0	2168	1423	0	2	2366	1003	0	0	2058	951
Otros	105	62	427	1157	88	190	307	933	69	154	350	1153
Total	177	177	5942	5942	280	280	5344	5344	224	224	4972	4972

* 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.