

Fecha de Publicación: 13 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 11 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\$1408,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,9%.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	473,0	190,8	67,0	333,0	19,8	36,0	104,0
15-35	380,8	457,4	289,0	174,8	12,4	50,1	156,0
36-60	32,6	14,6	10,0	0,0	4,6	32,6	0,0
61-90	15,6	13,5	10,0	0,0	3,5	15,6	0,0
91-180	1,7	33,7	25,0	0,0	8,7	1,7	0,0
>180	31,8	27,6	20,0	25,0	2,6	1,8	5,0
Total	935,5	737,6	421,0	532,8	51,6	137,7	265,0

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

*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	106	3651	3488	193	88	2797	3456	155	70	2612	2895
Intragruppo y off-shore***	0	0	2220	1665	0	2	2378	1074	0	0	2071	973
Otros	106	62	445	1162	88	192	308	954	70	155	350	1166
Total	169	169	6316	6316	282	282	5484	5484	224	224	5033	5033

* 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.