

Fecha de Publicación: 16 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 12 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\$1158,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,1%.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	228,7	104,8	73,5	184,5	16,3	29,2	15,0
15-35	258,6	520,2	408,0	27,3	8,2	127,3	104,0
36-60	74,6	21,0	20,0	0,0	1,0	74,6	0,0
61-90	0,0	11,6	5,0	0,0	6,6	0,0	0,0
91-180	9,8	22,7	20,2	7,0	2,5	2,8	0,0
>180	3,9	21,1	0,0	0,0	21,1	3,9	0,0
Total	575,7	701,4	526,7	218,8	55,7	237,9	119,0

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

*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	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**	63	108	3741	3509	193	88	2923	3516	155	69	2638	2925
Intragruppo y off-shore***	0	0	2240	1750	0	2	2424	1163	0	0	2089	995
Otros	108	63	440	1162	88	191	312	980	69	155	363	1170
Total	171	171	6421	6421	281	281	5659	5659	225	225	5090	5090

* 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.