

Fecha de Publicación: 18 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 16 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\$580,2 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	164,0	73,2	20,0	49,0	1,1	62,9	52,1
15-35	182,8	162,2	87,8	71,5	4,4	41,3	70,0
36-60	0,6	58,1	10,0	0,0	48,1	0,6	0,0
61-90	3,0	5,4	0,0	0,0	5,4	3,0	0,0
91-180	5,6	24,7	10,0	0,0	14,7	5,6	0,0
>180	14,6	8,1	5,0	0,0	3,1	14,6	0,0
Total	370,7	331,6	132,8	120,5	76,8	128,1	122,1

* 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	6,3 %	9,1 %	4,2 %	5,5 %
15-35	6,8 %	6,4 %	6,4 %	6,6 %
36-60	-	6,6 %	1,5 %	6,6 %
61-90	-	5,8 %	5,5 %	5,7 %
91-180	-	5,6 %	5,2 %	5,5 %
>180	-	5,2 %	3,7 %	4,0 %
Total	6,6 %	6,7 %	5,1 %	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	16 al 20 de Julio				23 al 27 de Julio				30 de Jul. al 3 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	193	89	3109	3637	156	76	2816	3103	152	71	1793	2482
Intragruppo y off-shore***	0	2	2431	1254	0	0	2129	1007	0	0	1694	483
Otros	89	191	379	1028	76	156	391	1226	71	152	292	814
Total	282	282	5920	5920	232	232	5335	5335	223	223	3779	3779

* 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.