

Fecha de Publicación: 19 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 17 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\$1701,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,4%.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	526,0	147,7	28,0	409,0	12,2	9,5	107,5
15-35	320,1	689,4	617,0	67,0	2,9	183,6	69,5
36-60	60,0	4,2	0,0	0,0	4,2	60,0	0,0
61-90	18,6	13,3	5,0	0,0	8,3	18,6	0,0
91-180	26,4	43,5	30,0	0,0	13,5	26,4	0,0
>180	0,5	29,2	15,0	0,0	14,2	0,5	0,0
Total	951,6	927,2	695,0	476,0	55,2	298,6	177,0

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

*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	81	3538	3688	157	81	2908	3185	152	71	1794	2509
Intragruppo y off-shore***	0	2	2431	1628	0	0	2157	1042	0	0	1718	483
Otros	81	191	372	1026	81	157	395	1233	71	152	295	815
Total	274	274	6342	6342	238	238	5460	5460	224	224	3807	3807

* 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.