

Fecha de Publicación: 23 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 18 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\$1320,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,2%.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	106,5	151,2	78,0	20,0	8,2	21,5	65,0
15-35	476,9	382,2	272,5	136,0	26,7	257,9	83,0
36-60	141,7	46,4	5,0	0,0	41,4	141,7	0,0
61-90	46,9	21,5	10,8	0,0	10,7	46,9	0,0
91-180	60,1	47,3	0,9	0,0	26,4	40,1	20,0
>180	0,0	7,7	5,0	0,0	2,7	0,0	0,0
Total	832,2	656,3	372,2	156,0	116,1	508,2	168,0

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

*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	78	3604	3746	157	84	2984	3312	153	71	1761	2486
Intragruppo y off-shore***	0	2	2466	1683	0	0	2235	1042	0	0	1693	448
Otros	78	191	376	1016	84	157	399	1264	71	153	297	817
Total	271	271	6446	6446	240	240	5618	5618	224	224	3751	3751

* 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.