

Fecha de Publicación: 24 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 19 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\$1402,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.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	463,9	405,1	99,0	196,0	71,1	32,9	235,0
15-35	330,7	385,0	274,5	55,0	14,5	179,7	96,0
36-60	19,4	11,0	0,0	0,0	11,0	19,4	0,0
61-90	27,2	29,4	10,0	0,0	19,4	27,2	0,0
91-180	11,7	19,8	6,5	0,0	13,4	11,7	0,0
>180	16,6	13,3	0,0	4,5	13,3	12,1	0,0
Total	869,5	863,7	390,0	255,5	142,7	283,0	331,0

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

*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**	192	78	3604	3746	157	85	3247	3584	155	74	1960	2618
Intragruppo y off-shore***	0	2	2466	1683	0	0	2284	1129	0	0	1743	557
Otros	78	190	376	1016	85	157	467	1285	74	155	299	827
Total	270	270	6446	6446	242	242	5997	5997	229	229	4002	4002

* 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.