

Fecha de Publicación: 31 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 27 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\$1210,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,0%.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	287,3	212,4	68,0	167,0	64,4	40,3	80,0
15-35	330,6	445,3	369,5	50,0	7,8	212,6	68,0
36-60	13,7	36,4	36,0	0,0	0,4	13,7	0,0
61-90	1,5	5,1	0,0	0,0	5,1	1,5	0,0
91-180	8,1	6,5	0,0	0,0	6,5	8,1	0,0
>180	0,4	11,2	10,0	0,0	1,2	0,4	0,0
Total	641,5	717,0	483,5	217,0	85,5	276,5	148,0

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

*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	23 al 27 de Julio				30 de Jul. al 3 de Agosto				6 al 10 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	158	87	3865	3923	157	80	2564	3213	161	59	2240	2615
Intragruppo y off-shore***	0	0	2465	1572	0	0	2058	864	0	0	1598	774
Otros	87	158	489	1324	80	157	383	928	59	161	361	811
Total	245	245	6819	6819	237	237	5005	5005	220	220	4200	4200

* 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.