

Fecha de Publicación: 2 de Agosto de 2012
 Fecha de Información: 31 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\$1048,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	200,1	202,0	122,1	123,6	15,0	11,5	65,0
15-35	284,4	298,4	240,5	69,4	42,9	200,0	15,0
36-60	12,5	0,7	0,0	5,0	0,7	7,5	0,0
61-90	18,1	11,5	0,0	0,0	11,5	18,1	0,0
91-180	9,7	45,0	10,0	5,0	35,0	4,7	0,0
>180	16,2	29,6	0,0	15,0	29,6	1,2	0,0
Total	540,9	587,2	372,6	218,0	134,7	242,9	80,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6,1 %	7,1 %	0,9 %	4,6 %
15-35	7,4 %	7,0 %	6,6 %	6,8 %
36-60	-	7,2 %	6,0 %	6,1 %
61-90	-	6,2 %	5,1 %	5,5 %
91-180	-	4,8 %	5,1 %	4,9 %
>180	-	3,6 %	5,1 %	4,1 %
Total	6,3 %	6,5 %	5,3 %	5,9 %

*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	30 de Jul. al 3 de Agosto				6 al 10 de Agosto				13 al 17 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	156	82	2924	3516	161	57	2510	2860	222	64	1626	2639
Intragrupa y off-shore***	0	0	2174	1031	0	0	1689	900	0	0	1864	464
Otros	82	156	387	939	57	161	383	823	64	222	290	677
Total	238	238	5485	5485	218	218	4582	4582	286	286	3780	3780

* 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.