

Fecha de Publicación: 7 de Agosto de 2012
 Fecha de Información: 03 de Agosto 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\$1123,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,5%.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	209,2	130,8	113,5	187,6	10,3	14,6	7,0
15-35	291,5	414,7	339,5	191,0	17,2	42,5	58,0
36-60	5,2	10,6	0,0	0,0	10,6	5,2	0,0
61-90	0,0	12,9	5,0	0,0	7,9	0,0	0,0
91-180	12,9	83,1	50,0	0,0	23,1	2,9	10,0
>180	16,1	11,5	0,0	5,0	11,5	11,1	0,0
Total	535,0	663,7	508,0	383,6	80,7	76,4	75,0

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

*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	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**	151	88	3276	3596	172	58	2829	3089	238	71	1810	2809
Intragruppo y off-shore***	0	0	2189	1320	0	2	1845	1115	0	0	1932	501
Otros	88	151	390	939	58	170	395	865	71	238	312	744
Total	239	239	5855	5855	230	230	5069	5069	309	309	4054	4054

* 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.