

Fecha de Publicación: 5 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 03 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\$1384,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,2%.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	273,3	143,1	60,0	141,1	13,6	62,7	69,5
15-35	554,6	412,7	308,1	120,0	53,1	383,1	51,5
36-60	44,6	3,4	0,0	0,0	3,4	44,6	0,0
61-90	0,3	9,5	0,0	0,0	9,5	0,3	0,0
91-180	1,3	36,1	0,0	0,5	36,1	0,9	0,0
>180	17,4	19,2	0,0	5,0	9,2	2,4	10,0
Total	891,6	624,0	368,1	266,6	124,9	494,0	131,0

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operacines 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	8,0 %	7,2 %	5,8 %	6,6 %
15-35	7,8 %	7,7 %	7,5 %	7,6 %
36-60	-	7,7 %	7,4 %	7,4 %
61-90	-	5,3 %	5,6 %	5,3 %
91-180	-	5,7 %	5,1 %	5,7 %
>180	5,2 %	5,0 %	4,2 %	5,0 %
Total	7,7 %	7,3 %	7,0 %	7,2 %

*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	2 al 6 de Julio				9 al 13 de Julio				16 al 20 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	94	57	1816	2036	60	100	2605	2996	187	84	2245	3008
Intragrupa y off-shore***	0	0	1188	498	10	0	2034	862	0	0	2185	942
Otros	57	94	305	775	90	60	341	1122	84	187	297	777
Total	151	151	3309	3309	160	160	4979	4979	272	272	4727	4727

* 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.