

Fecha de Publicación: 9 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 05 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\$1801,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,1%.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	399,2	270,3	172,2	228,8	4,1	76,4	94,0
15-35	615,9	565,3	386,0	203,0	15,3	248,9	164,0
36-60	7,3	1,9	0,0	0,0	1,9	7,3	0,0
61-90	33,5	99,8	95,0	7,8	4,8	25,7	0,0
91-180	0,0	27,6	10,0	0,0	17,6	0,0	0,0
>180	10,0	38,2	1,0	0,0	27,2	0,0	10,0
Total	1066,0	1003,2	664,2	439,6	71,0	358,4	268,0

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

*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	59	2075	2097	61	99	2829	3102	187	85	2349	3100
Intragruppo y off-shore***	0	0	1223	736	10	0	2101	1022	0	0	2255	957
Otros	59	94	300	766	89	61	336	1142	85	187	299	847
Total	154	154	3598	3598	161	161	5266	5266	272	272	4904	4904

* 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.