

Fecha de Publicación: 17 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 13 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\$1131,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,3%.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	244,1	257,8	27,0	54,0	105,8	65,1	125,0
15-35	249,6	314,0	224,0	138,0	26,2	47,8	63,8
36-60	5,9	7,6	0,0	0,0	7,6	5,9	0,0
61-90	0,7	104,1	30,4	0,0	73,7	0,7	0,0
91-180	30,2	63,6	32,4	0,0	31,1	30,2	0,0
>180	0,0	43,0	40,0	0,0	3,0	0,0	0,0
Total	530,4	790,2	353,8	192,0	247,6	149,6	188,8

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

*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	9 al 13 de Julio				16 al 20 de Julio				23 al 27 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	63	107	3746	3510	193	96	3012	3624	156	72	2791	3068
Intragruppo y off-shore***	0	0	2240	1750	0	2	2431	1205	0	0	2109	1007
Otros	107	63	441	1167	96	191	383	997	72	156	390	1215
Total	170	170	6427	6427	288	288	5826	5826	228	228	5290	5290

* 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.