

Fecha de Publicación: 25 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 23 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\$1189,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,6%.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	210,2	179,3	35,0	67,0	25,3	24,2	119,0
15-35	390,5	491,9	384,0	28,0	11,9	266,5	96,0
36-60	2,7	58,9	0,0	0,0	58,9	2,7	0,0
61-90	5,7	5,8	5,0	0,0	0,8	5,7	0,0
91-180	40,1	10,6	0,0	0,0	10,6	40,1	0,0
>180	6,5	2,3	0,0	0,0	2,3	6,5	0,0
Total	655,7	748,8	424,0	95,0	109,7	345,7	215,0

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

*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	23 al 27 de Julio				30 de Jul. al 3 de Agosto				6 al 10 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	157	84	3352	3662	156	74	2063	2717	160	62	1920	2302
Intragruppo y off-shore***	0	0	2309	1171	0	0	1753	582	0	0	1429	606
Otros	84	157	469	1298	74	156	320	837	62	160	282	724
Total	242	242	6131	6131	230	230	4136	4136	222	222	3632	3632

* 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.