

Fecha de Publicación: 26 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 24 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\$1688,9 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	311,4	449,9	318,4	145,3	19,5	54,1	112,0
15-35	511,8	399,9	224,3	85,0	16,6	267,8	159,0
36-60	96,7	17,5	0,0	0,0	17,5	96,7	0,0
61-90	54,6	3,6	0,0	0,2	3,6	54,4	0,0
91-180	52,2	68,6	20,0	0,6	13,6	16,6	35,0
>180	14,2	14,6	10,0	0,0	4,6	14,2	0,0
Total	1040,8	954,1	572,7	231,1	75,4	503,8	306,0

* 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	6,1 %	6,8 %	5,2 %	6,1 %
15-35	5,4 %	6,8 %	7,2 %	6,7 %
36-60	-	6,6 %	6,4 %	6,4 %
61-90	-	6,1 %	5,7 %	5,8 %
91-180	6,1 %	5,8 %	5,0 %	5,8 %
>180	-	5,3 %	4,3 %	4,5 %
Total	5,7 %	6,8 %	6,3 %	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	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**	158	85	3479	3869	156	74	2247	2890	161	62	1972	2439
Intragruppo y off-shore***	0	0	2442	1205	0	0	1863	693	0	0	1505	606
Otros	85	158	484	1330	74	156	330	857	62	161	294	726
Total	243	243	6404	6404	231	231	4440	4440	223	223	3771	3771

* 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.