

Fecha de Publicación: 27 de Julio de 2012
 Fecha de Información: 25 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\$1197,6 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	286,6	67,5	24,0	216,5	18,5	45,1	25,0
15-35	354,3	409,9	355,5	145,5	25,4	179,8	29,0
36-60	64,0	5,8	0,0	0,0	5,8	64,0	0,0
61-90	4,3	0,8	0,0	0,0	0,8	4,3	0,0
91-180	8,7	34,1	30,0	0,0	4,1	8,7	0,0
>180	6,4	9,3	5,0	0,0	4,3	6,4	0,0
Total	724,2	527,4	414,5	362,0	58,9	308,2	54,0

* 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	8,5 %	7,6 %	5,1 %	5,7 %
15-35	7,2 %	6,4 %	6,2 %	6,4 %
36-60	-	6,1 %	6,2 %	6,2 %
61-90	-	5,1 %	5,6 %	5,5 %
91-180	-	4,0 %	5,1 %	4,2 %
>180	-	2,8 %	4,0 %	3,5 %
Total	7,8 %	6,3 %	5,8 %	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	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	3629	3906	156	75	2319	2902	161	62	2076	2467
Intragruppo y off-shore***	0	0	2450	1337	0	0	1863	733	0	0	1527	681
Otros	85	158	488	1324	75	156	343	889	62	161	299	755
Total	243	243	6567	6567	231	231	4525	4525	223	223	3902	3902

* 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.