

Fecha de Publicación: 01 de Agosto de 2012

Fecha de Información: 30 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\$1375,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,5%.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	432,6	361,7	85,0	169,0	26,6	13,5	250,1
15-35	349,6	326,4	234,8	185,0	17,6	90,6	74,0
36-60	60,2	58,7	0,0	0,0	58,7	60,2	0,0
61-90	0,0	3,2	0,0	0,0	3,2	0,0	0,0
91-180	1,6	16,3	10,0	0,0	6,3	1,6	0,0
>180	25,6	68,5	21,0	20,0	42,5	0,6	5,0
Total	869,6	834,8	350,8	374,0	154,9	166,5	329,1

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

*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	30 de Jul. al 3 de Agosto				6 al 10 de Agosto				13 al 17 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	157	86	2780	3447	161	59	2455	2727	222	64	1573	2632
Intragruppo y off-shore***	0	0	2132	914	0	0	1609	893	0	0	1864	444
Otros	86	157	381	931	59	161	375	820	64	222	283	644
Total	244	244	5292	5292	220	220	4439	4439	286	286	3720	3720

* 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.