

Fecha de Publicación: 23 de Agosto de 2012
 Fecha de Información: 21 de Agosto 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\$1712,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	503,7	318,2	135,0	333,5	63,2	50,2	120,0
15-35	300,4	619,2	497,5	48,0	89,7	220,4	32,0
36-60	54,4	1,0	0,0	0,0	1,0	54,4	0,0
61-90	5,5	4,1	0,0	0,0	4,1	5,5	0,0
91-180	3,3	11,9	0,0	0,0	11,9	3,3	0,0
>180	12,3	30,9	20,0	0,0	10,9	12,3	0,0
Total	879,5	985,2	652,5	381,5	180,7	346,0	152,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,9 %	5,2 %	4,0 %	4,5 %
15-35	6,2 %	6,2 %	5,9 %	6,1 %
36-60	-	5,4 %	5,5 %	5,5 %
61-90	-	5,1 %	4,3 %	4,6 %
91-180	-	4,7 %	4,0 %	4,6 %
>180	-	3,9 %	4,0 %	3,9 %
Total	5,2 %	5,8 %	4,8 %	5,3 %

*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

Sector	20 al 24 de Agosto				27 al 31 de Agosto				3 al 7 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	149	81	3263	3545	32	114	2371	2890	163	73	1989	2561
Intragrupo y off-shore***	0	0	2191	833	0	0	1866	707	0	0	1838	688
Otros	81	149	473	1548	114	32	376	1016	73	163	298	875
Total	230	230	5926	5926	145	145	4614	4614	237	237	4125	4125

* 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 intragrupo.