

Fecha de Publicación: 27 de Agosto de 2012
 Fecha de Información: 23 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\$1769,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,9%.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	400,9	119,9	15,0	254,0	17,8	59,8	87,1
15-35	536,8	850,3	634,2	132,5	31,1	219,3	185,0
36-60	2,3	7,3	0,0	0,0	7,3	2,3	0,0
61-90	17,1	43,8	40,0	0,0	3,8	17,1	0,0
91-180	2,6	7,7	0,0	0,0	5,7	0,6	2,0
>180	24,3	35,3	27,0	0,0	3,3	19,3	5,0
Total	984,0	1064,2	716,2	386,5	68,9	318,4	279,1

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

*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	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**	150	68	3633	3608	34	116	2670	3035	163	73	2213	2662
Intragruppo y off-shore***	0	0	2192	1141	0	0	1931	890	0	0	1903	865
Otros	68	150	480	1556	116	34	394	1070	73	163	296	884
Total	218	218	6305	6305	150	150	4995	4995	237	237	4411	4411

* 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.