

Fecha de Publicación: 28 de Agosto de 2012
 Fecha de Información: 24 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\$1166,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	275,6	304,3	112,6	65,1	29,8	48,5	162,0
15-35	334,5	414,9	325,5	88,0	2,4	159,5	87,0
36-60	2,2	3,1	0,4	0,0	2,7	2,2	0,0
61-90	4,0	23,9	20,0	0,0	3,9	4,0	0,0
91-180	5,5	20,0	6,0	0,0	9,0	0,5	5,0
>180	25,0	7,4	0,0	0,0	7,4	25,0	0,0
Total	646,9	773,7	464,4	153,1	55,3	239,8	254,0

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

*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	3613	34	117	2922	3315	164	74	2235	2686
Intragrupa y off-shore***	0	0	2192	1141	0	0	2036	950	0	0	1911	870
Otros	68	150	485	1556	117	34	407	1100	74	164	312	901
Total	218	218	6310	6310	150	150	5365	5365	237	237	4457	4457

* 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.