

Fecha de Publicación: 03 de Septiembre de 2012

Fecha de Información: 30 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\$1234,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.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	156,3	179,9	154,8	112,5	15,1	33,8	10,0
15-35	406,6	373,6	321,0	204,8	13,6	162,8	39,0
36-60	1,0	17,4	7,5	0,0	9,9	1,0	0,0
61-90	9,0	25,3	0,0	0,0	25,3	9,0	0,0
91-180	5,7	7,7	0,0	0,0	7,7	5,7	0,0
>180	31,1	85,2	67,0	0,0	3,2	16,1	15,0
Total	609,8	689,1	550,3	317,3	74,8	228,5	64,0

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

Sectores	27 al 31 de Agosto				3 al 7 de Septiembre				10 al 14 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	89	3618	3574	168	77	2481	2891	41	72	2258	2839
Intragrupa y off-shore***	0	0	2152	1489	0	0	2003	981	0	0	1790	876
Otros	89	33	439	1147	77	168	360	972	72	41	557	890
Total	122	122	6209	6209	246	246	4845	4845	113	113	4605	4605

* 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.