

Fecha de Publicación: 05 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 03 de Septiembre 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\$97,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,2%.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 | 53,6 | 33,8 | 0,0 | 13,0 | 3,8 | 10,5 | 30,0 |
| 15-35 | 23,3 | 2,1 | 0,0 | 9,0 | 2,1 | 14,3 | 0,0 |
| 36-60 | 0,7 | 0,1 | 0,0 | 0,0 | 0,1 | 0,7 | 0,0 |
| 61-90 | 3,9 | 3,8 | 0,0 | 0,0 | 3,8 | 3,9 | 0,0 |
| 91-180 | 0,0 | 5,6 | 0,0 | 0,0 | 5,6 | 0,0 | 0,0 |
| >180 | 0,0 | 0,6 | 0,0 | 0,0 | 0,6 | 0,0 | 0,0 |
| Total | 81,5 | 45,9 | 0,0 | 22,0 | 15,9 | 29,4 | 30,0 |

* 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 intragruppo | | Total |
|--------------|--------------------|-------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 5,8 % | 5,5 % | 4,9 % | 5,4 % |
| 15-35 | - | 7,8 % | 4,5 % | 4,8 % |
| 36-60 | - | 10,5 % | 4,2 % | 5,3 % |
| 61-90 | - | 6,0 % | 4,6 % | 5,3 % |
| 91-180 | - | 5,1 % | - | 5,1 % |
| >180 | - | 4,6 % | - | 4,6 % |
| Total | 5,8 % | 5,8 % | 4,7 % | 5,2 % |

*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 | 3 al 7 de Septiembre | | | | 10 al 14 de Septiembre | | | | 17 al 21 de Septiembre | | | |
|----------------------------|----------------------|------------|-------------|-------------|------------------------|------------|-------------|-------------|------------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 170 | 71 | 2631 | 2968 | 49 | 72 | 2327 | 2903 | 64 | 65 | 2403 | 2987 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 2014 | 1041 | 0 | 1 | 1790 | 884 | 0 | 0 | 2232 | 836 |
| Otros | 71 | 170 | 396 | 1032 | 72 | 48 | 566 | 896 | 65 | 64 | 286 | 1097 |
| Total | 240 | 240 | 5041 | 5041 | 121 | 121 | 4683 | 4683 | 129 | 129 | 4921 | 4921 |

* 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.