

Fecha de Publicación: 10 de Agosto de 2012
 Fecha de Información: 08 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\$1224,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,4%.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	264,2	149,1	26,4	167,2	49,6	24,0	73,0
15-35	387,4	364,9	245,6	177,0	63,3	154,4	56,0
36-60	1,1	0,1	0,0	0,0	0,1	1,1	0,0
61-90	4,1	21,1	0,0	0,0	21,1	4,1	0,0
91-180	50,4	83,3	67,8	0,0	15,5	50,4	0,0
>180	20,4	7,7	5,0	20,0	2,7	0,4	0,0
Total	727,6	626,3	344,8	364,2	152,5	234,3	129,0

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

*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	6 al 10 de Agosto				13 al 17 de Agosto				20 al 24 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	170	58	3153	3139	239	79	1954	2961	142	67	2281	2379
Intragrupa y off-shore***	0	2	1845	1369	6	0	1952	538	0	0	1619	530
Otros	58	168	395	885	72	239	398	805	67	142	310	1301
Total	228	228	5393	5393	318	318	4304	4304	208	208	4210	4210

* 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.