

Fecha de Publicación: 15 de Agosto de 2012
 Fecha de Información: 13 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\$1264,8 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 | 440,6 | 520,7 | 216,2 | 142,3 | 71,5 | 65,3 | 233,0 |
| 15-35 | 200,3 | 236,4 | 175,1 | 154,4 | 54,3 | 38,9 | 7,0 |
| 36-60 | 32,8 | 0,4 | 0,0 | 0,0 | 0,4 | 32,8 | 0,0 |
| 61-90 | 1,7 | 1,9 | 0,0 | 0,0 | 1,9 | 1,7 | 0,0 |
| 91-180 | 5,6 | 11,8 | 0,0 | 0,0 | 11,8 | 5,6 | 0,0 |
| >180 | 37,5 | 35,2 | 12,0 | 0,0 | 3,2 | 17,5 | 20,0 |
| Total | 718,5 | 806,3 | 403,3 | 296,7 | 143,1 | 161,8 | 260,0 |

* 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 | 4,2 % | 6,1 % | 2,6 % | 4,5 % |
| 15-35 | 6,1 % | 5,5 % | 5,8 % | 5,7 % |
| 36-60 | - | 7,6 % | 5,4 % | 5,4 % |
| 61-90 | - | 5,6 % | 5,0 % | 5,3 % |
| 91-180 | - | 4,1 % | 4,9 % | 4,4 % |
| >180 | 4,0 % | 4,4 % | 4,4 % | 4,2 % |
| Total | 4,2 % | 5,8 % | 4,4 % | 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 | 13 al 17 de Agosto | | | | 20 al 24 de Agosto | | | | 27 al 31 de Agosto | | | |
|----------------------------|--------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 241 | 83 | 2672 | 3395 | 142 | 69 | 2434 | 2816 | 23 | 110 | 1868 | 2249 |
| Intragruppo y off-shore*** | 6 | 0 | 2068 | 884 | 0 | 0 | 1868 | 530 | 0 | 0 | 1530 | 523 |
| Otros | 77 | 241 | 417 | 880 | 69 | 142 | 402 | 1359 | 110 | 23 | 303 | 930 |
| Total | 325 | 325 | 5158 | 5158 | 211 | 211 | 4704 | 4704 | 133 | 133 | 3702 | 3702 |

* 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.