

Fecha de Publicación: 16 de Agosto de 2012
 Fecha de Información: 14 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\$1435,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.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	302,8	307,4	60,7	42,0	45,8	59,8	201,0
15-35	429,6	453,9	310,6	162,8	40,3	163,8	103,0
36-60	38,0	40,4	35,0	19,3	0,4	13,7	5,0
61-90	12,3	8,1	0,0	0,0	8,1	12,3	0,0
91-180	19,9	36,2	15,0	0,0	21,2	19,9	0,0
>180	37,7	70,1	54,0	2,0	4,1	23,7	12,0
Total	840,2	916,1	475,3	226,0	119,9	293,2	321,0

* 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	2,9 %	11,9 %	4,6 %	5,2 %
15-35	4,5 %	5,9 %	5,6 %	5,5 %
36-60	5,2 %	5,3 %	4,1 %	5,0 %
61-90	-	5,5 %	4,9 %	5,1 %
91-180	-	5,1 %	4,2 %	4,8 %
>180	4,3 %	4,2 %	4,1 %	4,2 %
Total	3,5 %	6,7 %	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	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	2715	3464	148	72	2674	3055	29	111	1896	2254
Intragruppo y off-shore***	6	0	2118	911	0	0	1879	545	0	0	1530	543
Otros	77	241	436	896	72	148	430	1383	111	29	309	938
Total	324	324	5270	5270	219	219	4982	4982	140	140	3736	3736

* 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.