

Fecha de Publicación: 17 de Agosto de 2012
 Fecha de Información: 15 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\$1699,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.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	316,8	191,1	111,5	198,0	29,6	68,8	50,0
15-35	412,5	685,7	545,6	150,0	24,1	146,5	116,1
36-60	21,3	63,9	10,0	0,0	43,9	11,3	10,0
61-90	20,4	5,7	0,0	0,0	5,7	20,4	0,0
91-180	44,9	30,3	10,0	0,0	15,3	39,9	5,0
>180	72,1	20,8	5,0	30,6	10,8	36,5	5,0
Total	888,1	997,6	682,1	378,6	129,4	323,5	186,1

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

*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	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	78	2944	3502	161	75	2733	3202	30	111	1935	2355
Intragruppo y off-shore***	6	0	2126	1109	0	0	1978	545	0	0	1608	543
Otros	72	241	442	902	75	161	452	1417	111	30	311	957
Total	319	319	5512	5512	237	237	5163	5163	141	141	3855	3855

* 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.