

Fecha de Publicación: 30 de Agosto de 2012
 Fecha de Información: 28 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\$1196,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.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	171,4	270,3	139,2	40,9	46,3	45,7	84,9
15-35	349,3	369,8	234,0	129,5	14,3	98,3	121,5
36-60	64,7	41,0	29,0	0,0	12,0	64,7	0,0
61-90	2,7	10,0	0,0	0,0	10,0	2,7	0,0
91-180	18,5	26,8	10,0	0,0	16,8	18,5	0,0
>180	55,8	22,7	10,0	0,0	12,7	55,8	0,0
Total	662,4	740,7	422,2	170,4	112,1	285,7	206,4

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

*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	27 al 31 de Agosto				3 al 7 de Septiembre				10 al 14 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	95	3250	3563	165	77	2383	2841	41	71	2201	2598
Intragrupa y off-shore***	0	0	2149	1122	0	0	1973	952	0	0	1594	854
Otros	95	33	431	1145	77	165	350	913	71	41	537	880
Total	128	128	5830	5830	241	241	4706	4706	112	112	4332	4332

* 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.