

Fecha de Publicación: 31 de Agosto de 2012
 Fecha de Información: 29 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\$1673,9 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	356,8	73,2	24,0	297,9	24,2	33,9	25,0
15-35	509,9	560,2	509,6	195,7	5,2	268,7	45,5
36-60	2,0	5,8	0,0	0,0	5,8	2,0	0,0
61-90	10,2	84,8	80,0	5,7	4,8	4,5	0,0
91-180	16,6	11,3	3,0	5,7	8,3	10,9	0,0
>180	65,6	47,9	45,0	22,9	2,9	42,7	0,0
Total	961,1	783,2	661,6	527,9	51,2	362,7	70,5

* 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	1,3 %	6,6 %	4,5 %	4,4 %
15-35	6,5 %	6,5 %	5,3 %	5,9 %
36-60	-	7,3 %	4,7 %	6,6 %
61-90	-	3,5 %	4,3 %	3,5 %
91-180	-	4,9 %	4,1 %	4,5 %
>180	-	4,1 %	3,8 %	4,0 %
Total	4,6 %	5,8 %	4,9 %	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	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	97	3548	3568	165	77	2415	2841	41	72	2236	2714
Intragruppo y off-shore***	0	0	2152	1419	0	0	1973	953	0	0	1665	862
Otros	97	33	433	1146	77	165	350	944	72	41	557	882
Total	129	129	6133	6133	242	242	4738	4738	113	113	4458	4458

* 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.