

Fecha de Publicación: 5 de Septiembre de 2012

Fecha de Información: 31 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\$853,1 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	177,1	100,9	11,0	56,0	34,9	66,1	55,0
15-35	239,4	359,2	220,8	55,0	52,4	98,4	86,0
36-60	11,8	3,0	0,0	0,0	3,0	11,8	0,0
61-90	14,6	18,6	5,0	0,0	13,6	14,6	0,0
91-180	13,0	25,6	0,0	0,0	20,6	8,0	5,0
>180	3,1	32,7	30,0	0,0	2,7	3,1	0,0
Total	459,1	540,0	266,8	111,0	127,2	202,1	146,0

* 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	5,8 %	4,3 %	4,4 %	4,8 %
15-35	4,7 %	6,4 %	5,6 %	5,8 %
36-60	-	5,5 %	5,0 %	5,1 %
61-90	-	3,7 %	4,8 %	4,2 %
91-180	5,1 %	5,4 %	4,4 %	5,1 %
>180	-	4,2 %	3,7 %	4,1 %
Total	5,1 %	5,7 %	5,0 %	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**	32	87	3621	3578	169	77	2606	2947	41	72	2310	2884
Intragruppo y off-shore***	0	0	2152	1489	0	0	2014	1029	0	0	1790	884
Otros	87	32	443	1149	77	169	390	1034	72	41	563	893
Total	119	119	6215	6215	245	245	5011	5011	113	113	4662	4662

* 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.