

Fecha de Publicación: 17 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 13 de Septiembre 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\$1351,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.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	91,7	211,7	180,0	32,1	8,2	36,1	23,5
15-35	288,1	481,2	410,4	95,4	5,4	127,2	65,5
36-60	40,4	10,7	0,0	0,0	10,7	40,4	0,0
61-90	26,7	9,1	0,0	20,0	9,1	6,7	0,0
91-180	167,0	108,6	0,0	125,0	73,6	7,0	35,0
>180	32,3	7,7	0,0	28,0	7,7	4,3	0,0
Total	646,3	829,1	590,4	300,5	114,7	221,8	124,0

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

*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	10 al 14 de Septiembre				17 al 21 de Septiembre				24 al 28 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	56	64	3482	3667	74	79	3016	3670	73	92	2710	3022
Intragruppo y off-shore***	0	1	2005	1519	5	0	2616	1140	0	0	2059	1016
Otros	64	54	826	1127	74	74	382	1205	92	73	476	1208
Total	119	119	6313	6313	153	153	6015	6015	165	165	5246	5246

* 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.