

Fecha de Publicación: 19 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 17 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\$1228,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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	262,7	246,5	142,2	187,3	62,3	33,4	42,0
15-35	300,4	354,8	209,6	96,0	20,2	79,4	125,0
36-60	45,1	20,8	0,0	0,0	20,8	45,1	0,0
61-90	0,0	3,7	0,0	0,0	3,7	0,0	0,0
91-180	74,6	76,8	5,0	0,0	21,8	24,6	50,0
>180	37,9	22,4	5,0	37,9	17,4	0,1	0,0
Total	720,8	724,9	361,8	321,2	146,1	182,6	217,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,6 %	4,7 %	1,8 %	3,4 %
15-35	3,0 %	4,7 %	4,0 %	4,1 %
36-60	-	4,2 %	4,1 %	4,2 %
61-90	-	4,6 %	4,0 %	4,6 %
91-180	4,1 %	4,6 %	4,1 %	4,2 %
>180	-	4,8 %	3,7 %	4,4 %
Total	3,4 %	4,7 %	3,2 %	3,9 %

*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	17 al 21 de Septiembre				24 al 28 de Septiembre				1 al 5 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	74	78	3617	3961	74	90	2839	3267	122	38	1795	2286
Intragrupa y off-shore***	5	0	2756	1578	0	0	2180	1055	0	0	1664	706
Otros	73	74	427	1260	90	74	551	1248	38	122	229	696
Total	153	153	6800	6800	164	164	5570	5570	160	160	3688	3688

* 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.