

Fecha de Publicación: 27 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 25 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\$1564,3 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	359,5	362,4	295,4	281,4	27,0	38,1	40,0
15-35	350,4	305,5	243,3	90,0	19,2	217,4	43,0
36-60	20,2	8,1	0,8	20,0	7,3	0,2	0,0
61-90	20,1	30,1	20,0	20,0	10,1	0,1	0,0
91-180	136,7	46,2	0,0	0,0	46,2	136,7	0,0
>180	5,9	7,2	0,0	0,0	2,2	0,9	5,0
Total	892,7	759,6	559,5	411,4	112,1	393,3	88,0

* 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	6,0 %	5,0 %	1,9 %	3,5 %
15-35	4,4 %	4,3 %	4,5 %	4,4 %
36-60	-	5,3 %	4,7 %	4,9 %
61-90	-	5,1 %	4,7 %	5,0 %
91-180	-	4,9 %	4,4 %	4,5 %
>180	4,0 %	4,4 %	3,4 %	4,0 %
Total	5,1 %	4,7 %	3,5 %	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	24 al 28 de Septiembre				1 al 5 de Octubre				8 al 12 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	74	87	3878	3960	123	37	2190	2894	38	47	1714	2227
Intragruppo y off-shore***	0	0	2463	1602	0	0	2174	901	0	0	1446	760
Otros	87	74	671	1451	37	123	262	831	47	38	334	507
Total	161	161	7012	7012	160	160	4626	4626	85	85	3494	3494

* 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.