

Fecha de Publicación: 11 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 07 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\$1015,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupos y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	342,5	282,3	23,8	105,2	110,5	89,3	148,0
15-35	293,3	201,6	94,0	185,5	30,6	30,8	77,0
36-60	3,0	13,0	0,0	0,0	13,0	3,0	0,0
61-90	10,0	23,2	0,0	0,0	13,2	0,0	10,0
91-180	4,5	40,0	0,0	0,0	40,0	4,5	0,0
>180	5,2	36,8	5,0	0,0	26,8	0,2	5,0
Total	658,6	596,8	122,8	290,7	234,1	127,9	240,0

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

*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	3 al 7 de Septiembre				10 al 14 de Septiembre				17 al 21 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	176	61	2952	3026	55	70	2868	3354	68	74	2666	3262
Intragrupos y off-shore***	0	0	2029	1415	0	1	1906	1079	0	0	2368	996
Otros	61	176	411	951	70	54	718	1058	74	68	366	1142
Total	237	237	5392	5392	125	125	5492	5492	142	142	5400	5400

* 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.