

Fecha de Publicación: 14 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 12 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\$1618,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	334,4	274,0	193,3	246,3	25,8	33,1	55,0
15-35	361,7	359,4	299,5	207,0	8,9	103,7	51,0
36-60	112,9	93,8	30,0	10,0	63,8	102,9	0,0
61-90	2,5	23,9	0,0	0,0	23,9	2,5	0,0
91-180	83,3	68,1	0,5	60,0	47,6	3,3	20,0
>180	23,9	6,6	0,0	20,0	6,6	3,9	0,0
Total	918,6	825,8	523,3	543,3	176,5	249,3	126,0

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

*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**	55	63	3454	3662	76	79	2954	3542	72	92	2710	2941
Intragrupa y off-shore***	0	1	2005	1499	5	0	2511	1128	0	0	1984	1016
Otros	63	54	822	1119	74	76	383	1178	92	72	471	1208
Total	118	118	6281	6281	155	155	5848	5848	164	164	5165	5165

* 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.