

Fecha de Publicación: 18 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 14 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\$1482,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	504,7	269,5	96,0	316,6	58,4	73,0	115,1
15-35	186,3	340,6	269,0	58,7	16,6	72,7	55,0
36-60	0,2	14,5	0,0	0,0	14,5	0,2	0,0
61-90	0,3	89,5	5,0	0,0	84,5	0,3	0,0
91-180	135,5	76,5	0,0	30,0	71,5	100,5	5,0
>180	30,3	14,5	0,0	25,0	9,5	0,3	5,0
Total	857,4	805,1	370,0	430,3	255,0	247,0	180,1

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

*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

Sector	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	52	3484	3667	75	78	3415	3819	73	92	2816	3142
Intragruppo y off-shore***	0	1	2005	1519	5	0	2669	1428	0	0	2102	1045
Otros	52	54	827	1130	73	75	414	1251	92	73	503	1235
Total	108	108	6315	6315	153	153	6498	6498	165	165	5422	5422

* 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.