

Fecha de Publicación: 20 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 18 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\$969,5 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	243,7	135,9	45,0	63,0	26,9	116,7	64,0
15-35	303,3	327,5	127,0	102,0	43,5	44,3	157,0
36-60	49,9	30,6	0,0	0,0	30,6	49,9	0,0
61-90	0,0	7,2	0,0	0,0	7,2	0,0	0,0
91-180	52,1	13,5	0,0	10,0	13,5	42,1	0,0
>180	16,9	19,9	0,0	5,0	9,9	1,9	10,0
Total	665,9	534,6	172,0	180,0	131,6	254,9	231,0

* 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	3,1 %	2,8 %	4,9 %	4,1 %
15-35	4,3 %	4,5 %	3,1 %	4,0 %
36-60	-	4,5 %	4,4 %	4,4 %
61-90	-	4,8 %	3,9 %	4,8 %
91-180	-	4,3 %	4,1 %	4,1 %
>180	3,5 %	4,0 %	3,2 %	3,6 %
Total	3,9 %	4,1 %	4,1 %	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	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**	73	83	3748	4009	74	90	2923	3312	122	38	1916	2381
Intragruppo y off-shore***	5	0	2766	1633	0	0	2190	1060	0	0	1734	768
Otros	78	73	436	1308	90	74	556	1297	38	122	239	740
Total	156	156	6950	6950	165	165	5670	5670	160	160	3889	3889

* 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.