

Fecha de Publicación: 21 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 19 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\$1544,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.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	580,0	280,6	130,0	410,5	30,6	49,5	120,0
15-35	151,4	547,0	507,0	44,9	4,0	70,5	36,0
36-60	0,7	4,0	0,0	0,0	4,0	0,7	0,0
61-90	3,0	20,7	10,0	1,0	8,7	0,0	2,0
91-180	50,0	55,3	0,0	0,0	35,3	30,0	20,0
>180	5,0	25,2	0,0	0,0	25,2	5,0	0,0
Total	790,3	932,6	647,0	456,4	107,6	155,9	178,0

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

*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	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	95	4159	4097	74	88	3038	3481	122	39	1971	2482
Intragrupa y off-shore***	5	0	2790	1983	0	0	2286	1076	0	0	1824	813
Otros	90	73	445	1314	88	74	573	1341	39	122	240	740
Total	168	168	7394	7394	162	162	5898	5898	160	160	4035	4035

* 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.