

Fecha de Publicación: 24 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 20 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\$1390,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.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	125,9	142,9	84,0	44,6	18,9	41,3	40,0
15-35	336,5	600,3	457,4	45,0	74,9	223,5	68,0
36-60	8,1	5,6	0,9	0,0	4,7	8,1	0,0
61-90	0,5	12,6	5,0	0,0	7,6	0,5	0,0
91-180	86,9	114,9	20,0	15,0	69,9	46,9	25,0
>180	79,8	19,4	0,0	22,0	9,4	47,8	10,0
Total	637,7	895,6	567,3	126,6	185,4	368,1	143,0

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

*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	96	4189	4103	74	88	3136	3617	122	38	1974	2521
Intragruppo y off-shore***	5	0	2790	2004	0	0	2370	1098	0	0	1863	815
Otros	91	73	451	1324	88	74	585	1377	38	122	240	741
Total	169	169	7430	7430	162	162	6092	6092	160	160	4077	4077

* 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.