

Fecha de Publicación: 25 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 21 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\$720,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.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	226,7	178,1	40,0	47,3	14,1	55,4	124,0
15-35	152,6	207,9	96,3	21,0	43,6	63,6	68,0
36-60	31,4	22,7	0,0	0,0	22,7	31,4	0,0
61-90	7,1	3,8	0,0	0,0	3,8	7,1	0,0
91-180	42,2	15,3	0,0	10,0	15,3	32,2	0,0
>180	10,0	15,2	10,0	0,0	5,2	10,0	0,0
Total	470,0	442,9	146,3	78,3	104,7	199,8	192,0

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

*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	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	93	4189	4103	74	98	3348	3793	122	37	1992	2522
Intragrupa y off-shore***	5	0	2790	2004	0	0	2405	1131	0	0	1868	829
Otros	88	73	450	1324	98	74	603	1432	37	122	236	745
Total	166	166	7430	7430	172	172	6356	6356	160	160	4096	4096

* 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.