

Fecha de Publicación: 26 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 24 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\$1173,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.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	365,3	169,7	69,0	261,6	60,6	63,6	40,1
15-35	210,1	338,7	234,0	89,5	68,7	84,6	36,0
36-60	0,7	1,4	0,0	0,0	1,4	0,7	0,0
61-90	20,0	4,8	0,0	20,0	4,8	0,0	0,0
91-180	47,6	19,8	10,0	20,0	9,8	27,6	0,0
>180	31,5	60,4	0,0	10,0	40,4	1,5	20,0
Total	675,1	594,8	313,0	401,1	185,7	178,0	96,1

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

*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	24 al 28 de Septiembre				1 al 5 de Octubre				8 al 12 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	74	88	3562	3900	123	38	2144	2597	38	46	1713	2214
Intragruppo y off-shore***	0	0	2437	1321	0	0	1905	901	0	0	1437	760
Otros	88	74	667	1446	38	123	244	795	46	38	330	507
Total	162	162	6666	6666	160	160	4293	4293	84	84	3481	3481

* 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.