

Fecha de Publicación: 10 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 06 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\$1608,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,2%.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	257,9	312,1	161,0	169,7	90,1	27,3	61,0
15-35	515,9	481,1	369,0	159,5	19,1	263,4	93,0
36-60	1,0	28,7	8,0	0,0	20,7	1,0	0,0
61-90	51,4	8,1	0,0	0,0	8,1	51,4	0,0
91-180	62,8	27,0	4,0	53,0	22,8	9,6	0,2
>180	8,0	8,8	0,0	0,0	8,8	8,0	0,0
Total	897,0	865,8	542,0	382,2	169,6	360,7	154,2

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

*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	3 al 7 de Septiembre				10 al 14 de Septiembre				17 al 21 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	176	63	2940	3026	54	73	2623	3132	66	74	2572	3200
Intragrupa y off-shore***	0	0	2029	1415	0	1	1890	1014	0	0	2361	956
Otros	63	176	411	939	73	53	629	997	74	66	342	1119
Total	240	240	5380	5380	127	127	5143	5143	139	139	5274	5274

* 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.