

Fecha de Publicación: 13 de Septiembre de 2012
 Fecha de Información: 11 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\$1265,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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	388,9	151,5	19,0	269,5	47,1	34,0	85,4
15-35	272,3	362,1	265,5	171,3	20,6	25,0	76,0
36-60	68,9	52,5	25,0	15,0	27,5	53,9	0,0
61-90	0,0	11,4	0,0	0,0	11,4	0,0	0,0
91-180	26,1	65,4	5,0	0,0	40,4	6,1	20,0
>180	21,8	39,2	15,0	5,0	11,2	3,8	13,0
Total	778,2	682,0	329,5	460,8	158,1	123,0	194,4

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

*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	10 al 14 de Septiembre				17 al 21 de Septiembre				24 al 28 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	55	69	3331	3592	71	79	2841	3371	78	92	2573	2905
Intragruppo y off-shore***	0	1	1941	1399	5	0	2387	1061	0	0	1974	937
Otros	69	54	815	1096	74	71	371	1167	92	78	465	1170
Total	124	124	6087	6087	150	150	5599	5599	170	170	5012	5012

* 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.