

Fecha de Publicación: 04 de Octubre de 2012
 Fecha de Información: 02 de Octubre 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\$1299,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	411,2	217,8	54,0	211,3	3,8	39,9	160,0
15-35	396,2	468,1	245,0	140,5	90,6	123,2	132,5
36-60	0,6	1,6	0,0	0,0	1,6	0,6	0,0
61-90	24,8	4,7	0,0	0,0	4,7	24,8	0,0
91-180	27,0	6,3	0,0	0,0	3,3	24,0	3,0
>180	15,0	27,3	19,6	0,0	2,6	10,0	5,0
Total	874,7	725,7	318,6	351,8	106,6	222,4	300,5

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

*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	1 al 5 de Octubre				8 al 12 de Octubre				15 al 19 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	131	40	2890	3506	61	48	2228	2754	8	73	1599	2150
Intragrupo y off-shore***	0	0	2435	1171	0	1	1677	967	0	0	1313	425
Otros	40	131	286	935	48	59	406	591	73	8	391	728
Total	171	171	5611	5611	108	108	4311	4311	81	81	3303	3303

* 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.