

Fecha de Publicación: 05 de Octubre de 2012
 Fecha de Información: 03 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\$1427,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,4%.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	376,7	135,7	123,8	345,1	11,9	31,6	0,0
15-35	177,4	414,7	304,1	106,0	61,8	22,6	48,8
36-60	138,9	133,2	80,0	80,0	53,2	58,9	0,0
61-90	26,7	7,1	6,0	26,0	1,1	0,7	0,0
91-180	13,2	34,3	25,0	0,0	9,3	13,2	0,0
>180	16,1	4,7	0,0	10,0	1,7	3,1	3,0
Total	749,1	729,7	538,9	567,1	139,0	130,2	51,8

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

*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**	141	39	3117	3533	62	48	2343	2854	9	73	1622	2159
Intragrupo y off-shore***	0	0	2461	1392	0	1	1775	1068	0	0	1313	447
Otros	39	141	287	939	48	61	409	605	73	9	400	729
Total	180	180	5865	5865	110	110	4526	4526	82	82	3335	3335

* 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.