

Fecha de Publicación: 11 de Octubre de 2012
 Fecha de Información: 09 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\$1137,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.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	191,1	98,8	63,0	103,5	10,8	62,6	25,0
15-35	406,1	300,9	134,5	253,2	120,4	106,9	46,0
36-60	20,5	15,8	0,5	0,0	5,4	10,5	10,0
61-90	5,2	6,5	0,0	0,0	6,5	5,2	0,0
91-180	87,6	22,0	0,0	85,0	22,0	2,6	0,0
>180	20,0	59,0	15,0	5,0	29,0	0,0	15,0
Total	730,5	503,1	213,0	446,7	194,1	187,8	96,0

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

*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	8 al 12 de Octubre				15 al 19 de Octubre				22 al 26 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	65	46	2835	3294	11	76	1842	2434	90	95	1694	1955
Intragrupa y off-shore***	0	1	2056	1318	0	0	1468	524	0	0	1220	445
Otros	46	63	427	706	76	11	405	757	95	90	373	887
Total	111	111	5318	5318	87	87	3715	3715	185	185	3287	3287

* 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.