

Fecha de Publicación: 18 de octubre de 2012
 Fecha de Información: 16 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\$1223,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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	363,5	168,6	50,0	250,9	38,6	32,7	80,0
15-35	294,4	406,6	276,5	128,0	58,1	94,4	72,0
36-60	44,2	49,2	33,8	33,0	15,4	11,2	0,0
61-90	0,6	5,3	0,0	0,0	5,3	0,6	0,0
91-180	23,1	32,8	0,0	0,0	10,8	1,1	22,0
>180	2,3	6,5	5,0	0,0	1,5	2,3	0,0
Total	728,1	669,1	365,3	411,9	129,8	142,3	174,0

* 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	3,7 %	3,7 %	3,3 %	3,4 %
15-35	2,1 %	4,5 %	4,3 %	4,1 %
36-60	-	4,1 %	3,5 %	3,8 %
61-90	-	5,8 %	5,0 %	5,7 %
91-180	5,3 %	5,6 %	5,5 %	5,4 %
>180	-	4,8 %	3,9 %	4,5 %
Total	3,3 %	4,4 %	3,7 %	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	15 al 19 de octubre				22 al 26 de octubre				29 de oct. al 2 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	63	2515	2975	91	96	1958	2242	7	99	2237	2630
Intragrupa y off-shore***	0	0	1592	769	0	0	1328	550	0	0	1508	734
Otros	63	12	476	839	96	91	406	899	99	7	602	982
Total	76	76	4583	4583	186	186	3691	3691	106	106	4346	4346

* 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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) \wedge (360 / \text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.