

Fecha de Publicación: 22 de octubre de 2012
 Fecha de Información: 18 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\$1896,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	215,5	286,2	191,9	83,7	20,3	57,8	74,0
15-35	504,9	791,7	528,5	163,5	79,2	157,4	184,0
36-60	4,7	68,0	60,0	0,0	8,0	4,7	0,0
61-90	0,0	30,4	25,0	0,0	5,4	0,0	0,0
91-180	126,6	37,7	17,2	80,0	20,4	46,6	0,0
>180	62,3	26,9	0,0	50,0	26,9	12,3	0,0
Total	914,0	1240,9	822,6	377,2	160,3	278,7	258,0

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

*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	70	2744	3187	91	96	2199	2499	9	101	2370	2756
Intragruppo y off-shore***	0	0	1745	970	0	0	1466	635	0	0	1572	817
Otros	70	12	510	842	96	91	425	956	101	9	634	1002
Total	81	81	4999	4999	187	187	4090	4090	110	110	4576	4576

* 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.