

Fecha de Publicación: 23 de octubre de 2012
 Fecha de Información: 19 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\$1237,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.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	391,3	374,5	82,2	75,0	7,3	31,3	285,0
15-35	257,2	475,8	275,0	63,0	15,8	9,2	185,0
36-60	34,1	5,1	0,0	30,0	5,1	4,1	0,0
61-90	24,6	18,5	9,5	0,0	9,0	24,6	0,0
91-180	36,8	14,4	10,0	0,0	4,4	36,8	0,0
>180	40,1	35,7	35,0	30,0	0,7	10,1	0,0
Total	784,0	923,9	411,7	198,0	42,2	116,0	470,0

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

* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas 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	3186	91	89	2368	2647	9	101	2589	2988
Intragruppo y off-shore***	0	0	1745	970	0	0	1528	710	0	0	1592	817
Otros	70	12	509	842	89	91	438	978	101	9	634	1009
Total	82	82	4998	4998	180	180	4334	4334	111	111	4815	4815

* 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.