

Fecha de Publicación: 01 de noviembre de 2012

Fecha de Información: 30 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\$1045,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	352,8	302,9	89,4	98,2	2,1	43,2	211,4
15-35	344,7	260,5	114,6	99,0	37,9	137,7	108,0
36-60	7,5	28,8	6,3	0,0	22,6	7,5	0,0
61-90	15,9	25,1	0,0	0,0	10,1	0,9	15,0
91-180	2,6	7,2	0,0	0,0	7,2	2,6	0,0
>180	16,5	15,3	10,0	0,0	5,3	16,5	0,0
Total	740,0	639,8	220,3	197,2	85,1	208,4	334,4

* 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	2,5 %	5,1 %	2,6 %	2,9 %
15-35	3,8 %	5,1 %	4,8 %	4,7 %
36-60	-	5,5 %	4,1 %	5,2 %
61-90	4,1 %	4,5 %	3,9 %	4,2 %
91-180	-	4,7 %	3,8 %	4,4 %
>180	-	4,3 %	3,3 %	3,8 %
Total	3,0 %	5,1 %	4,0 %	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	29 de oct. al 2 de noviembre				5 al 9 de noviembre				12 al 16 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	96	3610	3899	89	100	2342	2588	32	55	1851	2290
Intragrupa y off-shore***	0	0	2161	1306	0	0	1355	730	0	0	1490	935
Otros	96	12	722	1287	100	89	401	780	55	32	393	509
Total	108	108	6492	6492	189	189	4098	4098	86	86	3734	3734

* 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.