

Fecha de Publicación: 2 de noviembre de 2012
 Fecha de Información: 31 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\$1572,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupos y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	395,7	240,3	109,0	250,0	25,3	39,7	106,0
15-35	238,7	533,4	372,2	56,0	69,2	90,7	92,0
36-60	70,7	70,6	54,0	0,0	6,6	60,7	10,0
61-90	5,4	12,7	0,0	0,0	12,7	5,4	0,0
91-180	87,8	55,2	0,0	49,0	35,2	18,8	20,0
>180	66,9	53,0	20,0	0,0	3,0	36,9	30,0
Total	865,2	965,2	555,2	355,0	152,0	252,2	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	5,6 %	5,1 %	3,9 %	4,6 %
15-35	4,8 %	5,1 %	4,4 %	4,9 %
36-60	4,4 %	4,5 %	4,1 %	4,3 %
61-90	-	4,9 %	3,9 %	4,6 %
91-180	4,2 %	4,1 %	3,9 %	4,0 %
>180	3,7 %	3,8 %	3,4 %	3,6 %
Total	4,9 %	4,9 %	4,0 %	4,6 %

*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**	18	96	3861	3991	89	102	2423	2693	32	55	1906	2388
Intragrupos y off-shore***	0	0	2188	1499	0	0	1417	757	0	0	1567	965
Otros	96	18	721	1279	102	89	424	814	55	32	394	515
Total	114	114	6770	6770	191	191	4264	4264	87	87	3868	3868

* 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.