

Fecha de Publicación: 10 de Octubre de 2012
 Fecha de Información: 08 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\$147,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.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	43,6	10,1	0,0	31,8	0,1	1,9	10,0
15-35	36,9	15,3	0,0	10,0	5,3	16,9	10,0
36-60	7,8	1,8	0,0	0,0	1,8	7,8	0,0
61-90	5,6	1,0	0,0	0,0	1,0	5,6	0,0
91-180	0,0	13,3	0,0	0,0	13,3	0,0	0,0
>180	0,0	32,3	31,8	0,0	0,6	0,0	0,0
Total	93,9	73,9	31,8	41,8	22,1	32,1	20,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,0 %	6,6 %	-1,9 %	-0,2 %
15-35	5,8 %	6,0 %	5,2 %	5,4 %
36-60	-	6,9 %	4,3 %	4,8 %
61-90	-	5,9 %	4,4 %	4,6 %
91-180	-	5,2 %	1,9 %	5,2 %
>180	-	4,5 %	-	4,5 %
Total	2,9 %	5,6 %	4,6 %	4,4 %

*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	8 al 12 de Octubre				15 al 19 de Octubre				22 al 26 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	65	47	2731	3257	11	75	1785	2376	90	95	1638	1900
Intragruppo y off-shore***	0	1	2023	1241	0	0	1438	518	0	0	1195	415
Otros	47	64	423	679	75	11	402	730	95	90	343	860
Total	112	112	5177	5177	86	86	3625	3625	185	185	3175	3175

* 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 intragruppo.