

Fecha de Publicación: 19 de octubre de 2012
 Fecha de Información: 17 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\$1255,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.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	354,1	280,1	144,6	249,7	55,5	24,4	80,0
15-35	238,0	349,5	235,0	134,5	69,5	58,5	45,0
36-60	0,1	18,9	0,0	0,0	18,9	0,1	0,0
61-90	46,4	1,2	0,0	0,0	1,2	46,4	0,0
91-180	9,5	21,0	0,0	5,0	21,0	4,5	0,0
>180	31,1	40,8	30,0	21,0	0,8	0,1	10,0
Total	679,1	711,4	409,6	410,2	166,8	133,9	135,0

* 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	2,9 %	5,4 %	4,2 %	4,4 %
15-35	5,6 %	5,4 %	4,6 %	5,1 %
36-60	-	6,2 %	4,5 %	6,2 %
61-90	-	7,9 %	5,1 %	5,2 %
91-180	-	5,6 %	5,1 %	5,4 %
>180	4,3 %	4,5 %	4,7 %	4,6 %
Total	3,9 %	5,4 %	4,5 %	4,8 %

*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	65	2707	3163	91	96	2071	2314	8	99	2319	2661
Intragruppo y off-shore***	0	0	1737	933	0	0	1328	588	0	0	1508	817
Otros	65	12	494	842	96	91	423	920	99	8	633	981
Total	77	77	4937	4937	187	187	3822	3822	107	107	4460	4460

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.