

Fecha de Publicación: 31 de octubre de 2012
 Fecha de Información: 29 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\$1130,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	263,8	173,1	70,0	110,0	5,1	55,8	98,0
15-35	286,3	427,0	310,0	18,0	55,0	206,3	62,0
36-60	18,7	42,9	39,5	3,8	3,4	14,9	0,0
61-90	1,9	6,4	0,0	0,0	6,4	1,9	0,0
91-180	28,1	19,2	0,0	0,0	19,2	28,1	0,0
>180	22,3	0,6	0,0	0,4	0,6	21,9	0,0
Total	621,2	669,2	419,5	132,2	89,7	329,0	160,0

* 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	1,8 %	6,4 %	1,3 %	2,5 %
15-35	3,0 %	5,0 %	4,9 %	4,8 %
36-60	-	4,8 %	4,0 %	4,4 %
61-90	-	4,9 %	3,7 %	4,6 %
91-180	-	4,7 %	3,9 %	4,2 %
>180	-	4,6 %	3,6 %	3,6 %
Total	2,3 %	5,2 %	3,4 %	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

Sector	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**	13	95	3507	3806	89	101	2119	2379	32	54	1778	2242
Intragruppo y off-shore***	0	0	2103	1243	0	0	1323	694	0	0	1468	915
Otros	95	13	722	1282	101	89	400	768	54	32	392	481
Total	107	107	6332	6332	190	190	3842	3842	85	85	3638	3638

* 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.