

Fecha de Publicación: 06 de noviembre de 2012
 Fecha de Información: 01 de noviembre 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\$1873,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	454,4	495,1	215,7	138,7	34,4	70,7	245,0
15-35	511,4	669,6	436,8	163,0	17,3	132,9	215,5
36-60	87,7	5,1	0,0	83,0	5,1	4,7	0,0
61-90	5,3	10,6	0,0	0,0	5,6	0,3	5,0
91-180	24,2	41,1	20,0	0,0	6,1	9,2	15,0
>180	13,2	40,9	35,0	2,6	0,9	5,6	5,0
Total	1096,3	1262,4	707,5	387,3	69,5	223,5	485,5

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

* 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	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	93	3940	4014	103	102	2631	2994	43	55	2050	2568
Intragrupa y off-shore***	0	0	2189	1558	0	0	1629	837	0	0	1569	965
Otros	93	18	723	1279	102	103	427	857	55	43	432	518
Total	111	111	6851	6851	205	205	4687	4687	98	98	4052	4052

* 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.