

Fecha de Publicación: 03 de Octubre de 2012
 Fecha de Información: 01 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\$966,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.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	185,9	154,4	47,0	42,3	3,4	39,6	104,0
15-35	196,5	340,4	240,0	108,0	50,4	38,5	50,0
36-60	103,6	78,7	0,0	25,0	63,7	63,6	15,0
61-90	30,4	5,7	0,0	25,0	0,7	0,4	5,0
91-180	7,1	10,5	0,0	5,0	10,5	2,1	0,0
>180	1,3	25,5	5,0	0,0	20,5	1,3	0,0
Total	524,8	615,2	292,0	205,3	149,2	145,5	174,0

* 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	3,8 %	5,1 %	4,3 %	4,3 %
15-35	5,5 %	5,0 %	3,1 %	4,4 %
36-60	5,3 %	5,2 %	5,1 %	5,1 %
61-90	5,1 %	5,8 %	5,1 %	5,1 %
91-180	-	5,1 %	4,7 %	4,9 %
>180	-	4,0 %	3,5 %	4,0 %
Total	4,5 %	5,0 %	4,1 %	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	1 al 5 de Octubre				8 al 12 de Octubre				15 al 19 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	130	39	2753	3462	58	48	1959	2581	8	73	1529	1896
Intragrupa y off-shore***	0	0	2426	1088	0	0	1632	839	0	0	1109	405
Otros	39	130	301	930	48	58	389	559	73	8	391	727
Total	169	169	5479	5479	106	106	3979	3979	81	81	3028	3028

* 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.