

Fecha de Publicación: 09 de noviembre de 2012
 Fecha de Información: 07 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\$2362,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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	668,0	341,1	185,0	528,8	34,4	17,6	121,7
15-35	518,7	459,1	302,9	328,0	31,2	65,7	125,0
36-60	16,3	73,8	60,0	0,0	3,8	6,3	10,0
61-90	168,3	151,3	20,0	0,0	131,3	168,3	0,0
91-180	52,7	109,4	55,0	10,0	19,4	7,7	35,0
>180	27,3	78,6	40,0	16,3	28,6	1,0	10,0
Total	1451,3	1213,2	662,9	883,0	248,6	266,6	301,7

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

*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	5 al 9 de noviembre				12 al 16 de noviembre				19 al 23 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	103	70	3237	3402	46	164	2333	2870	30	88	2378	3312
Intragrupa y off-shore***	0	0	1736	1178	0	1	1758	1150	0	0	2168	971
Otros	70	103	512	906	164	44	459	529	88	30	463	726
Total	173	173	5486	5486	210	210	4549	4549	118	118	5009	5009

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.