

Fecha de Publicación: 14 de noviembre de 2012
 Fecha de Información: 09 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\$1042,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.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	197,1	219,5	48,0	60,5	64,5	29,6	107,0
15-35	226,9	397,1	302,1	73,5	15,0	73,4	80,0
36-60	18,6	30,7	8,0	0,0	7,7	3,6	15,0
61-90	29,2	75,8	30,0	0,0	20,8	4,2	25,0
91-180	0,6	11,1	0,0	0,0	11,1	0,6	0,0
>180	21,6	41,3	30,0	20,0	11,3	1,6	0,0
Total	493,9	775,4	418,1	154,0	130,3	112,9	227,0

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

*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	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	3297	3419	47	166	2521	3227	30	87	2652	3483
Intragrupa y off-shore***	0	0	1736	1222	0	1	1975	1201	0	0	2178	1118
Otros	70	103	518	910	166	46	489	556	87	30	532	760
Total	173	173	5551	5551	213	213	4984	4984	117	117	5361	5361

* 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.