

Fecha de Publicación: 15 de noviembre de 2012
 Fecha de Información: 13 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\$1188,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.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	266,8	190,7	52,0	113,6	13,6	28,1	125,1
15-35	337,6	317,5	250,6	225,0	4,3	49,9	62,7
36-60	22,1	26,9	20,0	0,0	6,9	22,1	0,0
61-90	65,4	61,7	0,0	0,0	61,7	65,4	0,0
91-180	0,6	64,8	20,0	0,0	44,8	0,6	0,0
>180	2,4	20,5	0,0	0,0	20,5	2,4	0,0
Total	694,7	682,0	342,6	338,6	151,7	168,3	187,8

* 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	5,2 %	3,6 %	4,2 %	4,5 %
15-35	4,7 %	4,8 %	4,1 %	4,4 %
36-60	-	4,8 %	4,2 %	4,5 %
61-90	-	4,3 %	4,2 %	4,2 %
91-180	-	4,2 %	3,1 %	4,2 %
>180	-	4,0 %	3,6 %	4,0 %
Total	5,0 %	4,5 %	4,1 %	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	12 al 16 de noviembre				19 al 23 de noviembre				26 al 30 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	53	167	2641	3323	30	89	2711	3526	34	86	2501	2768
Intragruppo y off-shore***	0	1	2022	1262	0	0	2183	1140	0	0	1579	951
Otros	167	51	498	576	89	30	534	762	86	34	525	886
Total	219	219	5161	5161	119	119	5428	5428	120	120	4605	4605

* 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.