

Fecha de Publicación: 16 de noviembre de 2012
 Fecha de Información: 14 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\$1228,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	314,7	123,9	68,0	286,0	45,9	18,7	10,0
15-35	208,7	396,6	369,2	176,7	4,4	9,0	23,0
36-60	1,9	6,1	0,0	0,0	6,1	1,9	0,0
61-90	89,6	79,1	10,0	0,0	49,1	69,6	20,0
91-180	1,4	10,3	0,0	0,0	10,3	1,4	0,0
>180	32,9	16,7	10,0	30,0	6,7	2,9	0,0
Total	649,2	632,8	457,2	492,7	122,6	103,5	53,0

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

*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	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**	51	170	2869	3340	30	97	2767	3632	35	86	2540	2805
Intragruppo y off-shore***	0	1	2022	1468	0	0	2251	1185	0	0	1616	986
Otros	170	50	505	587	97	30	571	772	86	35	526	890
Total	221	221	5395	5395	127	127	5589	5589	121	121	4682	4682

* 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.