

Fecha de Publicación: 23 de noviembre de 2012
 Fecha de Información: 21 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\$1613,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.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	244,6	266,8	155,0	103,2	14,7	44,3	97,1
15-35	294,8	595,0	473,2	95,0	20,3	98,3	101,5
36-60	117,7	65,1	0,0	55,0	65,1	62,7	0,0
61-90	43,0	73,3	60,0	15,0	3,3	18,0	10,0
91-180	78,0	21,8	0,0	20,0	21,8	58,0	0,0
>180	15,7	21,5	5,0	0,0	1,5	0,7	15,0
Total	793,6	1043,4	693,2	288,2	126,6	281,8	223,6

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,7 %	3,3 %	2,9 %	3,3 %
15-35	4,7 %	4,9 %	3,3 %	4,4 %
36-60	-	4,7 %	4,5 %	4,6 %
61-90	2,2 %	2,3 %	4,2 %	2,9 %
91-180	-	4,6 %	4,4 %	4,4 %
>180	4,1 %	4,5 %	3,9 %	4,2 %
Total	4,1 %	4,3 %	3,7 %	4,1 %

*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	19 al 23 de noviembre				26 al 30 de noviembre				3 al 7 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	103	3446	4012	40	91	3050	3376	64	87	2105	2297
Intragruppo y off-shore***	0	0	2441	1608	0	0	1875	1126	0	0	1543	1176
Otros	103	31	584	851	91	40	578	1001	87	64	436	613
Total	134	134	6471	6471	131	131	5502	5502	151	151	4085	4085

* 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 intragruppo.