

Fecha de Publicación: 05 de diciembre de 2012
 Fecha de Información: 03 de diciembre 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\$1008,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.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	140,0	156,8	113,5	95,0	3,3	5,0	40,0
15-35	265,4	241,7	177,0	212,0	15,7	4,4	49,0
36-60	56,4	12,9	0,2	40,0	12,7	16,4	0,0
61-90	51,0	93,7	40,0	0,0	53,7	51,0	0,0
91-180	5,7	9,4	0,0	0,0	4,4	0,7	5,0
>180	49,2	30,2	0,0	35,0	20,2	4,2	10,0
Total	567,8	544,7	330,7	382,0	110,0	81,7	104,0

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

* 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	3 al 7 de diciembre				10 al 14 de diciembre				17 al 21 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	69	68	2749	3064	90	96	2529	2966	40	125	1878	2531
Intragrupa y off-shore***	0	0	1920	1334	0	2	1596	1289	0	0	1801	1025
Otros	68	69	525	796	96	88	626	497	125	40	308	430
Total	138	138	5194	5194	186	186	4752	4752	165	165	3987	3987

* 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.