

Fecha de Publicación: 07 de diciembre de 2012
 Fecha de Información: 05 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\$1485,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	577,1	259,5	136,0	462,9	11,5	2,2	112,0
15-35	280,2	464,8	317,5	89,5	24,3	67,7	123,0
36-60	84,7	9,7	3,0	35,0	6,7	49,7	0,0
61-90	10,3	9,6	0,8	5,0	3,8	0,3	5,0
91-180	1,9	12,7	0,0	0,0	12,7	1,9	0,0
>180	7,7	7,5	0,0	5,0	7,5	2,7	0,0
Total	961,7	763,8	457,3	597,4	66,5	124,3	240,0

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

*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**	70	61	3211	3185	70	99	2987	3239	40	126	1965	2724
Intragrupa y off-shore***	0	0	1976	1729	0	2	1703	1494	0	0	1951	1068
Otros	61	70	542	815	99	69	638	595	126	40	311	434
Total	131	131	5729	5729	170	170	5329	5329	166	166	4226	4226

* 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.