

Fecha de Publicación: 11 de diciembre de 2012
 Fecha de Información: 07 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\$1612,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.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	261,1	137,9	19,5	112,5	98,4	128,6	20,0
15-35	334,0	395,3	302,0	252,8	43,3	31,2	50,0
36-60	118,0	152,2	0,0	14,0	152,2	104,0	0,0
61-90	123,3	127,9	60,9	90,0	48,0	14,3	19,0
91-180	2,0	24,2	0,0	0,0	24,2	2,0	0,0
>180	6,5	19,0	0,0	5,0	19,0	1,5	0,0
Total	844,9	856,4	382,4	474,3	385,1	281,6	89,0

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

* 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	62	3264	3261	74	105	3397	3621	41	138	2081	2799
Intragrupa y off-shore***	0	0	2022	1750	0	2	1760	1670	0	0	1984	1125
Otros	62	70	544	817	105	72	846	712	138	41	315	455
Total	132	132	5829	5829	179	179	6003	6003	179	179	4379	4379

* 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.