

Fecha de Publicación: 14 de diciembre de 2012
Fecha de Información: 12 de diciembre de 2012¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1036,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.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	55,8	177,7	131,5	9,0	6,2	6,8	40,0
15-35	177,9	331,0	216,5	69,5	21,5	15,4	93,0
36-60	49,6	18,3	0,0	10,0	8,3	29,6	10,0
61-90	294,4	141,1	20,0	125,0	41,1	89,4	80,0
91-180	1,9	5,3	0,0	0,0	5,3	1,9	0,0
>180	1,3	5,0	0,0	0,0	5,0	1,3	0,0
Total	580,8	678,4	368,0	213,5	87,4	144,3	223,0

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

* 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	10 al 14 de diciembre				17 al 21 de diciembre				24 al 28 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	54	111	3663	4020	41	145	2390	3175	66	186	1404	1961
Intragrupa y off-shore***	0	2	2112	1851	3	0	2187	1324	0	0	1169	767
Otros	111	53	865	769	142	41	394	472	186	66	317	162
Total	165	165	6640	6640	186	186	4971	4971	252	252	2890	2890

* 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.