

Fecha de Publicación: 17 de diciembre de 2012
 Fecha de Información: 13 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\$1373,0 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	44,4	258,6	165,3	37,6	93,3	6,8	0,0
15-35	381,2	477,5	318,0	87,0	20,5	155,2	139,0
36-60	0,8	13,8	8,0	0,0	5,8	0,8	0,0
61-90	58,9	159,2	10,0	20,0	119,2	8,9	30,0
91-180	77,5	15,2	0,0	65,0	5,2	2,5	10,0
>180	29,9	45,0	20,0	10,0	15,0	9,9	10,0
Total	592,6	969,4	521,3	219,6	259,1	184,0	189,0

* 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 %	0,8 %	2,8 %
15-35	3,1 %	2,9 %	1,5 %	2,4 %
36-60	-	3,6 %	2,7 %	3,6 %
61-90	3,1 %	3,0 %	2,3 %	2,9 %
91-180	3,4 %	3,5 %	3,0 %	3,1 %
>180	3,2 %	3,3 %	2,7 %	3,1 %
Total	3,1 %	3,1 %	1,7 %	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**	56	117	3667	4012	42	147	2419	3395	66	186	1425	1999
Intragrupa y off-shore***	0	2	2112	1855	3	0	2330	1350	0	0	1192	788
Otros	117	55	858	770	144	42	471	475	186	66	332	162
Total	173	173	6637	6637	189	189	5220	5220	251	251	2949	2949

* 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.