

Fecha de Publicación: 19 de diciembre de 2012
 Fecha de Información: 17 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\$869,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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	213,8	84,1	82,5	199,0	1,6	14,8	0,0
15-35	182,6	326,4	278,8	87,3	30,7	78,4	17,0
36-60	10,3	8,4	0,0	6,0	8,4	4,3	0,0
61-90	0,0	11,3	5,0	0,0	6,3	0,0	0,0
91-180	0,3	8,5	0,0	0,0	8,5	0,3	0,0
>180	15,5	25,1	0,0	15,0	25,1	0,5	0,0
Total	422,6	463,7	366,3	307,3	80,5	98,3	17,0

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

*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	17 al 21 de diciembre				24 al 28 de diciembre				31 de dic. al 4 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	42	149	2667	3647	66	191	1481	2013	2	23	1054	1457
Intragrupa y off-shore***	3	0	2480	1513	0	0	1203	834	0	0	1001	546
Otros	146	42	503	489	191	66	335	171	23	2	221	272
Total	191	191	5650	5650	256	256	3018	3018	25	25	2276	2276

* 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.