

Fecha de Publicación: 26 de diciembre de 2012
 Fecha de Información: 21 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\$974,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	42,3	108,2	41,3	22,0	53,4	6,8	13,5
15-35	298,9	451,3	359,5	72,8	32,8	167,1	59,0
36-60	7,7	19,6	0,0	0,0	19,6	7,7	0,0
61-90	8,1	32,4	0,0	0,0	32,4	8,1	0,0
91-180	0,7	32,8	0,0	0,0	32,8	0,7	0,0
>180	21,2	24,2	0,0	20,0	24,2	1,2	0,0
Total	379,0	668,4	400,8	114,8	195,2	191,7	72,5

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

*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**	67	160	3135	3770	66	184	1689	2300	2	24	1160	1655
Intragrupa y off-shore***	3	0	2521	1902	0	0	1400	985	0	0	1149	564
Otros	157	67	506	489	184	66	392	196	24	2	238	326
Total	227	227	6162	6162	250	250	3481	3481	26	26	2546	2546

* 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.