

Fecha de Publicación: 19 de noviembre de 2012
 Fecha de Información: 15 de noviembre 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\$1313,5 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	220,3	252,3	141,0	98,0	1,3	12,3	110,0
15-35	285,8	492,6	391,5	104,0	7,7	88,3	93,5
36-60	32,0	2,3	0,0	15,0	2,3	17,0	0,0
61-90	71,9	72,2	0,0	0,0	62,2	61,9	10,0
91-180	17,5	53,6	0,0	0,0	53,6	17,5	0,0
>180	18,7	7,8	5,0	10,0	2,8	8,7	0,0
Total	646,2	880,9	537,5	227,0	129,9	205,7	213,5

* 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	2,6 %	5,8 %	2,3 %	3,3 %
15-35	5,0 %	4,9 %	1,2 %	3,7 %
36-60	-	5,4 %	4,7 %	4,7 %
61-90	4,8 %	4,9 %	4,5 %	4,7 %
91-180	-	4,4 %	2,9 %	4,0 %
>180	-	4,2 %	3,5 %	3,8 %
Total	3,8 %	4,9 %	2,4 %	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	12 al 16 de noviembre				19 al 23 de noviembre				26 al 30 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	51	163	2963	3384	30	101	2822	3746	36	86	2612	2896
Intragrupa y off-shore***	0	1	2035	1531	0	0	2344	1210	0	0	1651	996
Otros	163	50	506	588	101	30	567	778	86	36	526	897
Total	214	214	5503	5503	131	131	5733	5733	121	121	4789	4789

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.