

Fecha de Publicación: 28 de diciembre de 2012
 Fecha de Información: 26 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\$1361,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	67,4	77,7	55,0	42,5	22,7	24,9	0,0
15-35	207,4	457,6	221,0	129,0	182,6	24,4	54,0
36-60	11,5	102,1	0,0	0,0	102,1	11,5	0,0
61-90	73,8	138,2	0,0	0,0	138,2	73,8	0,0
91-180	0,0	193,1	0,0	0,0	193,1	0,0	0,0
>180	0,3	85,9	0,0	0,0	85,9	0,3	0,0
Total	360,4	1054,5	276,0	171,5	724,5	134,9	54,0

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

*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	24 al 28 de diciembre				31 de dic. al 4 de enero				7 al 11 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	72	184	1771	2945	2	25	1200	1683	4	35	2380	2588
Intragrupa y off-shore***	0	0	1455	1027	0	0	1149	564	0	0	1477	1047
Otros	184	72	947	200	25	2	243	344	35	4	409	631
Total	256	256	4172	4172	27	27	2591	2591	39	39	4266	4266

* 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.