

Fecha de Publicación: 08 de noviembre de 2012
 Fecha de Información: 06 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\$1090,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.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 | 169,0 | 248,6 | 37,3 | 59,4 | 116,3 | 14,7 | 95,0 |
| 15-35 | 469,5 | 194,1 | 66,1 | 313,5 | 18,0 | 46,0 | 110,0 |
| 36-60 | 1,3 | 19,6 | 0,0 | 0,0 | 19,6 | 1,3 | 0,0 |
| 61-90 | 59,0 | 109,0 | 0,0 | 0,0 | 109,0 | 59,0 | 0,0 |
| 91-180 | 10,3 | 21,1 | 5,0 | 0,0 | 6,1 | 0,3 | 10,0 |
| >180 | 0,4 | 3,2 | 0,0 | 0,0 | 3,2 | 0,4 | 0,0 |
| Total | 709,6 | 595,6 | 108,4 | 372,9 | 272,2 | 121,7 | 215,0 |

* 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 | 1,8 % | 6,6 % | 4,3 % | 4,5 % |
| 15-35 | 1,9 % | 4,7 % | 4,2 % | 3,8 % |
| 36-60 | - | 5,2 % | 4,2 % | 5,1 % |
| 61-90 | - | 4,4 % | 4,0 % | 4,3 % |
| 91-180 | 3,8 % | 4,2 % | 3,5 % | 3,9 % |
| >180 | - | 4,3 % | 3,0 % | 4,2 % |
| Total | 2,0 % | 5,3 % | 4,1 % | 4,1 % |

*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 | 5 al 9 de noviembre | | | | 12 al 16 de noviembre | | | | 19 al 23 de noviembre | | | |
|---------------------------|---------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 103 | 105 | 2915 | 3207 | 46 | 164 | 2134 | 2763 | 29 | 89 | 2231 | 3214 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1646 | 921 | 0 | 1 | 1692 | 990 | 0 | 0 | 2118 | 853 |
| Otros | 104 | 103 | 472 | 905 | 164 | 44 | 454 | 527 | 89 | 29 | 434 | 716 |
| Total | 208 | 208 | 5033 | 5033 | 210 | 210 | 4280 | 4280 | 118 | 118 | 4783 | 4783 |

* 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.