

Fecha de Publicación: 27 de noviembre de 2012
 Fecha de Información: 23 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\$1196,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.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 | 194,5 | 204,0 | 127,0 | 105,0 | 4,0 | 16,5 | 73,0 |
| 15-35 | 359,7 | 447,0 | 326,8 | 207,0 | 4,2 | 36,7 | 116,0 |
| 36-60 | 31,7 | 0,4 | 0,0 | 30,0 | 0,4 | 1,7 | 0,0 |
| 61-90 | 62,9 | 12,3 | 0,0 | 35,0 | 2,3 | 17,9 | 10,0 |
| 91-180 | 16,7 | 52,8 | 5,0 | 0,0 | 42,8 | 11,7 | 5,0 |
| >180 | 17,1 | 1,3 | 0,0 | 5,0 | 1,3 | 12,1 | 0,0 |
| Total | 682,7 | 717,8 | 458,8 | 382,0 | 55,0 | 96,7 | 204,0 |

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

*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 | 19 al 23 de noviembre | | | | 26 al 30 de noviembre | | | | 3 al 7 de diciembre | | | |
|---------------------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 30 | 86 | 3446 | 4008 | 43 | 89 | 3199 | 3556 | 64 | 87 | 2160 | 2347 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 2441 | 1613 | 0 | 0 | 1983 | 1196 | 0 | 0 | 1563 | 1211 |
| Otros | 86 | 30 | 580 | 846 | 89 | 43 | 585 | 1015 | 87 | 64 | 459 | 624 |
| Total | 116 | 116 | 6467 | 6467 | 133 | 133 | 5767 | 5767 | 152 | 152 | 4182 | 4182 |

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.