

Fecha de Publicación: 28 de noviembre de 2012
 Fecha de Información: 26 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\$1126,8 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	164,5	228,3	169,2	83,6	1,1	22,9	58,0
15-35	279,7	274,6	172,5	164,5	13,1	26,2	89,0
36-60	41,4	30,2	0,0	5,0	10,2	16,4	20,0
61-90	59,4	35,6	0,0	0,0	35,6	59,4	0,0
91-180	93,0	121,6	38,0	0,8	9,6	18,2	74,0
>180	9,1	30,5	30,0	5,0	0,5	4,1	0,0
Total	647,0	720,8	409,7	258,9	70,1	147,1	241,0

* 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	4,8 %	3,6 %	1,5 %	3,1 %
15-35	2,4 %	4,9 %	4,6 %	4,2 %
36-60	4,6 %	5,0 %	3,4 %	4,2 %
61-90	-	4,1 %	3,8 %	3,9 %
91-180	4,2 %	4,1 %	4,2 %	4,2 %
>180	-	3,9 %	3,8 %	3,9 %
Total	3,7 %	4,2 %	3,6 %	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	26 al 30 de noviembre				3 al 7 de diciembre				10 al 14 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	43	90	3324	3692	64	87	2199	2436	87	93	2089	2625
Intragrupa y off-shore***	0	0	2093	1279	0	0	1622	1211	0	0	1474	1121
Otros	90	43	582	1029	87	64	459	633	93	87	586	403
Total	133	133	6000	6000	152	152	4281	4281	179	179	4148	4148

* 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.