

Fecha de Publicación: 3 de diciembre de 2012
 Fecha de Información: 29 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\$1092,0 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	156,3	76,3	48,0	79,0	13,3	62,3	15,0
15-35	218,8	230,1	164,7	160,0	45,5	38,8	20,0
36-60	55,2	22,6	0,5	24,0	22,1	31,2	0,0
61-90	142,1	95,3	0,0	0,0	95,3	142,1	0,0
91-180	32,6	47,1	5,0	10,0	42,1	22,6	0,0
>180	10,4	40,2	0,0	10,0	40,2	0,4	0,0
Total	615,5	511,6	218,2	283,0	258,4	297,5	35,0

* 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	4,7 %	4,2 %	3,0 %	3,4 %
15-35	1,1 %	4,0 %	3,5 %	3,7 %
36-60	-	4,5 %	4,3 %	4,4 %
61-90	-	4,0 %	4,1 %	4,1 %
91-180	-	4,2 %	3,9 %	4,1 %
>180	-	4,0 %	3,8 %	4,0 %
Total	2,7 %	4,1 %	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**	20	103	3737	3810	67	73	2516	2797	88	94	2366	2812
Intragrupa y off-shore***	0	0	2120	1575	0	0	1787	1249	0	0	1530	1241
Otros	103	20	584	1055	72	67	478	736	94	88	609	451
Total	123	123	6441	6441	139	139	4782	4782	182	182	4504	4504

* 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.