

Fecha de Publicación: 29 de noviembre de 2012
 Fecha de Información: 27 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\$1152,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
 Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 349,1 | 238,6 | 119,5 | 192,9 | 2,1 | 39,1 | 117,0 |
| 15-35 | 179,5 | 290,4 | 194,0 | 54,5 | 7,4 | 36,0 | 89,0 |
| 36-60 | 84,7 | 59,3 | 15,0 | 0,0 | 22,3 | 62,7 | 22,0 |
| 61-90 | 6,4 | 35,6 | 0,0 | 0,0 | 35,6 | 6,4 | 0,0 |
| 91-180 | 76,8 | 84,5 | 5,0 | 5,0 | 9,5 | 1,8 | 70,0 |
| >180 | 31,1 | 24,9 | 10,0 | 5,0 | 4,9 | 16,1 | 10,0 |
| Total | 727,5 | 733,3 | 343,5 | 257,4 | 81,8 | 162,1 | 308,0 |

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

* 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

| Sector | 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** | 42 | 86 | 3549 | 3807 | 64 | 87 | 2271 | 2540 | 87 | 91 | 2227 | 2683 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 2115 | 1412 | 0 | 0 | 1695 | 1220 | 0 | 0 | 1499 | 1192 |
| Otros | 86 | 42 | 589 | 1033 | 87 | 64 | 460 | 666 | 91 | 87 | 586 | 437 |
| Total | 129 | 129 | 6253 | 6253 | 152 | 152 | 4427 | 4427 | 178 | 178 | 4311 | 4311 |

* 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.