

Fecha de Publicación: 26 de noviembre de 2012
 Fecha de Información: 22 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\$79,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,7%.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	12,9	23,0	1,1	5,0	21,9	7,9	0,0
15-35	5,3	14,2	0,0	5,0	14,2	0,3	0,0
36-60	5,3	0,6	0,0	5,0	0,6	0,3	0,0
61-90	3,5	0,4	0,0	0,0	0,4	3,5	0,0
91-180	11,6	1,0	0,0	0,0	1,0	11,6	0,0
>180	0,8	0,4	0,0	0,0	0,4	0,8	0,0
Total	39,3	39,6	1,1	15,0	38,5	24,3	0,0

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

* 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**	31	103	3446	4012	41	91	3058	3377	64	87	2109	2318
Intragrupa y off-shore***	0	0	2441	1613	0	0	1876	1126	0	0	1543	1176
Otros	103	31	585	846	91	41	578	1009	87	64	458	617
Total	134	134	6472	6472	132	132	5512	5512	151	151	4111	4111

* 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.