

Fecha de Publicación: 02 de enero de 2013
Fecha de Información: 27 de diciembre 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\$716,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.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	135,4	93,3	10,0	40,0	6,3	18,4	77,0
15-35	198,3	348,1	172,0	40,0	68,1	50,3	108,0
36-60	6,5	20,5	0,0	0,0	20,5	6,5	0,0
61-90	57,2	32,7	0,0	0,0	32,7	57,2	0,0
91-180	2,6	3,3	0,0	0,0	3,3	2,6	0,0
>180	0,1	3,7	0,0	0,0	3,7	0,1	0,0
Total	400,2	501,6	182,0	80,0	134,6	135,2	185,0

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

*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	24 al 28 de diciembre				31 de dic. al 4 de enero				7 al 11 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	72	187	1826	2960	2	25	1254	1747	4	35	2403	2601
Intragrupa y off-shore***	0	0	1455	1067	0	0	1159	564	0	0	1477	1047
Otros	187	72	947	200	25	2	246	348	35	4	411	643
Total	259	259	4228	4228	28	28	2659	2659	39	39	4291	4291

* 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.