

Fecha de Publicación: 3 de enero de 2013

Fecha de Información: 28 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\$900,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.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	103,3	68,8	40,0	68,4	23,8	29,9	5,0
15-35	310,7	276,8	81,9	99,8	91,9	108,0	103,0
36-60	9,6	9,9	1,0	0,0	8,9	9,6	0,0
61-90	102,0	19,9	5,0	0,0	14,9	102,0	0,0
91-180	8,5	38,0	27,3	0,0	10,7	8,5	0,0
>180	21,4	39,3	35,0	20,0	4,3	1,4	0,0
Total	555,6	452,7	190,1	188,2	154,5	259,5	108,0

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

Sector	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	189	1826	2961	2	29	1284	1782	4	36	2476	2627
Intragrupo y off-shore***	0	0	1455	1067	0	0	1174	578	0	0	1502	1102
Otros	189	72	948	200	29	2	262	359	36	4	412	661
Total	261	261	4229	4229	31	31	2719	2719	40	40	4390	4390

* 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.