

Fecha de Publicación: 14 de enero de 2013

Fecha de Información: 10 de enero de 2013 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\$1254,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	212,4	292,8	115,5	51,5	42,3	25,9	135,0
15-35	369,4	414,9	255,8	68,0	34,1	176,5	125,0
36-60	18,9	34,6	17,0	17,0	17,6	1,9	0,0
61-90	18,6	56,1	25,0	0,0	31,1	18,6	0,0
91-180	21,2	54,4	0,0	0,0	54,4	21,2	0,0
>180	1,6	20,0	0,0	0,0	20,0	1,6	0,0
Total	642,1	872,8	413,3	136,5	199,5	245,7	260,0

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

*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	7 al 11 de enero				14 al 18 de enero				21 al 25 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	35	2917	3110	27	96	2672	2617	10	124	1858	2010
Intragrupa y off-shore***	0	1	1908	1491	0	0	1409	722	0	0	1162	549
Otros	35	14	426	651	96	27	565	1306	124	10	425	886
Total	50	50	5252	5252	123	123	4645	4645	134	134	3446	3446

* 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.