

Fecha de Publicación: 16 de enero de 2013

Fecha de Información: 14 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\$1084,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.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	236,0	233,2	124,7	84,5	63,5	106,5	45,0
15-35	196,1	229,0	161,6	138,9	24,4	14,2	43,0
36-60	87,3	80,9	12,0	12,0	68,9	75,3	0,0
61-90	3,9	4,2	0,1	0,0	4,2	3,9	0,0
91-180	10,5	35,0	0,0	0,0	35,0	10,5	0,0
>180	5,0	51,1	25,0	0,0	26,1	5,0	0,0
Total	538,9	633,4	323,3	235,4	222,1	215,5	88,0

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

*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	14 al 18 de enero				21 al 25 de enero				28 de ene. al 1 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	92	2916	2883	11	133	1964	2140	4	60	1483	2039
Intragrupa y off-shore***	0	0	1609	860	0	0	1212	572	0	0	1181	439
Otros	92	28	585	1367	133	11	475	939	60	4	497	683
Total	121	121	5110	5110	144	144	3651	3651	64	64	3161	3161

* 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.