

Fecha de Publicación: 15 de enero de 2013

Fecha de Información: 11 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\$907,5 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	152,2	167,2	124,8	76,3	12,4	45,9	30,0
15-35	240,8	161,4	129,0	91,5	14,4	131,3	18,0
36-60	70,7	70,5	64,0	64,0	6,5	6,7	0,0
61-90	0,0	5,7	0,0	0,0	5,7	0,0	0,0
91-180	13,0	35,7	0,0	0,0	35,7	13,0	0,0
>180	35,4	2,9	0,0	0,0	2,9	35,4	0,0
Total	512,2	443,4	317,8	231,8	77,6	232,4	48,0

* 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	3,1 %	2,3 %	1,8 %	2,1 %
15-35	3,3 %	2,7 %	2,8 %	2,8 %
36-60	-	2,7 %	2,6 %	2,6 %
61-90	-	4,0 %	-	4,0 %
91-180	-	3,6 %	3,2 %	3,5 %
>180	-	3,9 %	3,2 %	3,3 %
Total	3,1 %	2,7 %	2,5 %	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	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**	16	35	2917	3108	27	93	2785	2758	11	128	1860	2038
Intragrupa y off-shore***	0	3	1908	1491	0	0	1509	798	0	0	1187	549
Otros	35	14	425	651	93	27	575	1313	128	11	428	888
Total	51	51	5250	5250	120	120	4869	4869	139	139	3476	3476

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.