

Fecha de Publicación: 20 de enero de 2013

Fecha de Información: 17 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\$1591,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	416,7	116,2	36,9	158,1	23,1	202,4	56,3
15-35	254,0	568,1	534,7	131,0	4,2	93,7	29,3
36-60	90,9	90,4	29,0	29,0	61,4	61,9	0,0
61-90	33,3	2,7	0,0	20,0	2,7	13,3	0,0
91-180	0,5	24,9	0,0	0,0	24,9	0,5	0,0
>180	32,0	47,5	0,0	0,0	47,5	32,0	0,0
Total	827,4	849,9	600,5	338,1	163,9	403,8	85,5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,5 %	3,4 %	2,6 %	2,7 %
15-35	3,7 %	2,6 %	1,3 %	2,3 %
36-60	-	3,8 %	3,6 %	3,7 %
61-90	-	4,1 %	3,3 %	3,4 %
91-180	-	4,1 %	2,9 %	4,1 %
>180	-	3,8 %	3,5 %	3,7 %
Total	2,9 %	2,9 %	2,3 %	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	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**	30	78	3424	3045	14	136	2274	2273	6	60	1674	2135
Intragruppo y off-shore***	0	0	1717	981	0	0	1253	597	0	0	1236	573
Otros	78	30	617	1732	136	14	478	1135	60	6	505	708
Total	108	108	5758	5758	150	150	4004	4004	66	66	3416	3416

* 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 intragruppo.