

Fecha de Publicación: 23 de enero de 2013

Fecha de Información: 21 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\$223,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	63,6	42,3	15,0	21,2	7,3	22,4	20,0
15-35	45,0	67,4	55,2	29,0	12,2	16,0	0,0
36-60	0,0	2,7	0,0	0,0	2,7	0,0	0,0
61-90	3,1	0,6	0,0	0,0	0,6	3,1	0,0
91-180	2,2	7,4	0,0	0,0	7,4	2,2	0,0
>180	9,6	0,1	0,0	0,0	0,1	9,6	0,0
Total	123,6	120,3	70,2	50,2	30,1	53,4	20,0

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

* 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	21 al 25 de enero				28 de ene. al 1 de febrero				4 al 8 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	150	2535	2350	6	61	1755	2171	2	95	2252	2340
Intragrupa y off-shore***	0	0	1282	638	0	0	1246	581	0	0	1410	1062
Otros	150	17	487	1316	61	6	522	771	95	2	523	783
Total	166	166	4304	4304	67	67	3523	3523	97	97	4185	4185

* 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.