

Fecha de Publicación: 24 de enero de 2013

Fecha de Información: 22 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\$1404,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	393,0	197,5	35,0	109,0	63,5	185,0	99,0
15-35	284,8	475,7	291,0	46,0	63,7	117,8	121,0
36-60	73,9	8,6	0,0	0,0	8,6	73,9	0,0
61-90	24,8	17,8	0,0	0,0	17,8	24,8	0,0
91-180	31,6	49,8	0,0	0,0	49,8	31,6	0,0
>180	32,7	33,7	0,0	20,0	33,7	12,7	0,0
Total	840,9	783,1	326,0	175,0	237,1	445,9	220,0

* 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	3,8 %	4,4 %	2,7 %	3,3 %
15-35	4,4 %	4,4 %	4,2 %	4,3 %
36-60	-	4,6 %	3,8 %	3,9 %
61-90	-	4,3 %	3,5 %	3,8 %
91-180	-	3,7 %	3,6 %	3,7 %
>180	-	3,8 %	3,5 %	3,7 %
Total	4,1 %	4,3 %	3,3 %	3,8 %

*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

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	151	2715	2372	6	62	1956	2336	2	97	2344	2397
Intragrupa y off-shore***	0	0	1293	734	0	0	1268	594	0	0	1415	1062
Otros	151	17	489	1391	62	6	575	869	97	2	525	824
Total	167	167	4497	4497	68	68	3800	3800	100	100	4283	4283

* 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.