

Fecha de Publicación: 29 de enero de 2013

Fecha de Información: 25 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\$1582,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	499,9	63,2	50,0	337,0	3,2	152,9	10,0
15-35	376,4	608,0	539,0	194,0	14,1	127,4	55,0
36-60	2,5	26,2	0,0	0,0	26,2	2,5	0,0
61-90	9,5	4,3	0,0	0,0	4,3	9,5	0,0
91-180	2,0	13,8	0,0	0,0	13,8	2,0	0,0
>180	6,5	34,9	0,0	5,0	34,9	1,5	0,0
Total	896,8	750,4	589,0	536,0	96,5	295,9	65,0

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

* 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	124	3004	2425	6	68	2486	2385	2	103	2835	2502
Intragrupa y off-shore***	0	0	1304	922	0	0	1289	873	0	0	1476	1257
Otros	124	17	491	1452	68	6	592	1109	103	2	553	1104
Total	141	141	4799	4799	75	75	4366	4366	105	105	4863	4863

* 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.