

Fecha de Publicación: 30 de enero de 2013

Fecha de Información: 28 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\$947,5 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	183,6	34,0	29,0	97,5	5,0	86,1	0,0
15-35	298,5	260,3	207,5	118,7	16,8	143,8	36,0
36-60	49,3	23,5	0,0	0,0	8,5	34,3	15,0
61-90	23,9	34,9	30,0	0,0	4,9	23,9	0,0
91-180	26,5	14,6	0,0	0,0	14,6	26,5	0,0
>180	7,3	42,1	35,0	0,0	7,1	7,3	0,0
Total	589,1	409,4	301,5	216,2	56,9	321,9	51,0

* 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	-	3,4 %	3,1 %	3,1 %
15-35	2,5 %	3,3 %	3,3 %	3,2 %
36-60	3,5 %	4,0 %	3,1 %	3,3 %
61-90	-	3,4 %	3,3 %	3,4 %
91-180	-	3,9 %	3,3 %	3,5 %
>180	-	3,5 %	3,2 %	3,5 %
Total	2,8 %	3,4 %	3,2 %	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	28 de ene. al 1 de febrero				4 al 8 de febrero				11 al 15 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	6	79	2584	2372	2	103	2854	2532	3	93	2495	2598
Intragrupa y off-shore***	0	0	1289	965	0	0	1505	1263	0	0	1693	870
Otros	79	6	578	1115	103	2	553	1117	93	3	490	1211
Total	85	85	4451	4451	105	105	4912	4912	96	96	4679	4679

* 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.