

Fecha de Publicación: 31 de enero de 2013

Fecha de Información: 29 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\$1364,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.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	193,2	139,2	129,0	112,1	4,9	75,8	5,3
15-35	365,8	284,3	201,0	155,0	20,1	147,6	63,3
36-60	113,3	69,7	10,0	0,0	54,7	108,3	5,0
61-90	71,0	101,5	40,8	0,0	60,7	71,0	0,0
91-180	5,6	36,7	0,0	0,0	36,7	5,6	0,0
>180	30,7	56,8	25,0	0,0	1,8	0,7	30,0
Total	779,7	688,3	405,8	267,1	179,0	409,1	103,6

* 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	0,0 %	2,4 %	0,9 %	1,6 %
15-35	2,3 %	3,0 %	2,7 %	2,8 %
36-60	3,2 %	2,9 %	2,7 %	2,8 %
61-90	-	3,3 %	3,2 %	3,3 %
91-180	-	3,0 %	2,9 %	3,0 %
>180	3,1 %	3,2 %	3,1 %	3,2 %
Total	2,5 %	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	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**	7	83	2687	2378	2	102	2917	2664	3	90	2578	2605
Intragrupa y off-shore***	0	0	1289	1034	0	0	1634	1303	0	0	1695	873
Otros	83	7	579	1144	102	2	557	1140	90	3	495	1291
Total	89	89	4556	4556	104	104	5107	5107	92	92	4769	4769

* 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.