

Fecha de Publicación: 1 de febrero de 2013

Fecha de Información: 30 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\$1390,0 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 | 360,0 | 217,6 | 70,0 | 82,0 | 1,6 | 132,0 | 146,0 |
| 15-35 | 321,9 | 352,3 | 207,0 | 75,0 | 47,8 | 149,4 | 97,5 |
| 36-60 | 81,0 | 63,8 | 10,0 | 0,0 | 53,8 | 81,0 | 0,0 |
| 61-90 | 60,8 | 81,0 | 0,9 | 10,2 | 60,1 | 30,6 | 20,0 |
| 91-180 | 21,5 | 38,9 | 0,0 | 0,0 | 38,9 | 21,5 | 0,0 |
| >180 | 46,0 | 28,7 | 1,0 | 20,0 | 7,7 | 6,0 | 20,0 |
| Total | 891,2 | 782,3 | 288,8 | 187,2 | 210,0 | 420,5 | 283,5 |

* 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 | 2,5 % | 1,3 % | 1,8 % | 2,0 % |
| 15-35 | 1,9 % | 3,2 % | 2,7 % | 2,7 % |
| 36-60 | - | 2,9 % | 2,7 % | 2,8 % |
| 61-90 | 3,3 % | 3,3 % | 2,9 % | 3,2 % |
| 91-180 | - | 3,4 % | 2,9 % | 3,2 % |
| >180 | 3,1 % | 3,6 % | 2,5 % | 2,9 % |
| Total | 2,4 % | 3,0 % | 2,4 % | 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 | 82 | 2873 | 2459 | 2 | 180 | 3080 | 2691 | 3 | 90 | 2628 | 2644 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1309 | 1089 | 0 | 0 | 1659 | 1330 | 0 | 0 | 1720 | 873 |
| Otros | 82 | 7 | 580 | 1214 | 180 | 2 | 480 | 1197 | 90 | 3 | 498 | 1329 |
| Total | 89 | 89 | 4761 | 4761 | 182 | 182 | 5218 | 5218 | 93 | 93 | 4846 | 4846 |

* 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.