

Fecha de Publicación: 6 de febrero de 2013

Fecha de Información: 04 de febrero 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\$1104,5 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	200,1	249,2	91,0	16,4	36,2	61,7	122,0
15-35	381,9	287,8	129,0	125,0	7,8	105,9	151,0
36-60	36,2	8,9	5,0	0,0	3,9	36,2	0,0
61-90	9,9	4,2	0,0	0,0	4,2	9,9	0,0
91-180	33,4	26,8	21,0	21,0	5,8	12,4	0,0
>180	77,6	101,5	0,0	10,0	61,5	27,6	40,0
Total	739,1	678,5	246,0	172,4	119,5	253,7	313,0

* 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	4,3 %	4,1 %	0,3 %	3,2 %
15-35	2,7 %	3,1 %	2,9 %	2,9 %
36-60	-	2,6 %	1,7 %	1,9 %
61-90	-	3,8 %	3,0 %	3,2 %
91-180	-	0,9 %	1,2 %	1,1 %
>180	3,3 %	3,4 %	3,0 %	3,3 %
Total	3,4 %	3,3 %	2,1 %	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	4 al 8 de febrero				11 al 15 de febrero				18 al 22 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	183	3443	3127	15	92	2745	2811	12	96	2146	2580
Intragrupa y off-shore***	0	0	1900	1435	0	1	1826	901	0	0	1795	766
Otros	183	26	512	1293	92	13	525	1383	96	12	375	970
Total	209	209	5855	5855	107	107	5095	5095	108	108	4316	4316

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.