

Fecha de Publicación: 7 de febrero de 2013

Fecha de Información: 05 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\$1038,5 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	62,8	118,7	66,8	8,0	16,9	19,8	35,0
15-35	318,6	323,8	196,9	120,0	24,0	95,6	103,0
36-60	92,2	77,5	10,0	20,0	67,5	72,2	0,0
61-90	94,5	131,0	0,0	15,0	56,0	4,5	75,0
91-180	7,0	10,8	0,0	0,0	10,1	6,2	0,7
>180	6,9	9,3	0,0	0,0	8,2	5,8	1,1
Total	582,0	671,3	273,6	163,0	182,8	204,2	214,8

* 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	3,8 %	3,4 %	-1,3 %	2,5 %
15-35	3,0 %	3,6 %	3,2 %	3,3 %
36-60	-	3,3 %	3,1 %	3,2 %
61-90	3,7 %	3,6 %	3,1 %	3,6 %
91-180	3,2 %	2,2 %	2,7 %	2,4 %
>180	3,1 %	3,9 %	2,7 %	3,4 %
Total	3,4 %	3,5 %	2,8 %	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	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**	27	182	3484	3193	15	94	2766	2863	12	96	2166	2639
Intragrupa y off-shore***	0	0	1929	1443	0	1	1863	901	0	0	1849	777
Otros	182	27	530	1307	94	13	524	1389	96	12	375	974
Total	209	209	5943	5943	108	108	5154	5154	108	108	4390	4390

* 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.