

Fecha de Publicación: 8 de febrero de 2013

Fecha de Información: 06 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\$1865,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	399,0	168,2	48,3	254,0	9,0	34,0	111,0
15-35	417,2	663,8	511,6	45,0	22,2	242,2	130,0
36-60	73,5	78,0	0,0	0,0	78,0	73,5	0,0
61-90	174,0	96,9	0,0	0,0	28,9	106,0	68,0
91-180	30,7	16,3	0,0	10,0	1,3	5,7	15,0
>180	53,1	28,9	15,0	20,0	3,9	23,1	10,0
Total	1147,5	1052,2	574,9	329,0	143,3	484,5	334,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,8 %	3,8 %	1,8 %	2,0 %
15-35	2,9 %	3,5 %	3,3 %	3,3 %
36-60	-	3,1 %	2,9 %	3,0 %
61-90	1,8 %	3,4 %	3,3 %	2,8 %
91-180	1,0 %	4,7 %	3,0 %	2,2 %
>180	3,1 %	3,9 %	2,1 %	2,4 %
Total	2,2 %	3,4 %	2,8 %	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

Sectores	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	187	3720	3218	15	94	2899	2996	12	91	2201	2661
Intragruppo y off-shore***	0	0	1949	1675	0	1	1892	923	0	0	1858	777
Otros	187	27	535	1310	94	13	527	1399	91	12	378	999
Total	214	214	6203	6203	109	109	5318	5318	104	104	4438	4438

* 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 intragruppo.