

Fecha de Publicación: 12 de febrero de 2013

Fecha de Información: 08 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\$1156,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	252,4	109,2	5,0	44,0	44,2	148,4	60,0
15-35	334,8	424,0	290,3	127,2	50,3	124,1	83,5
36-60	9,0	7,8	0,0	9,0	7,8	0,0	0,0
61-90	54,2	26,8	0,8	10,0	5,9	24,2	20,0
91-180	3,2	29,7	0,0	0,0	29,7	3,2	0,0
>180	20,7	48,0	0,0	0,6	48,0	20,1	0,0
Total	674,2	645,4	296,1	190,7	185,8	320,0	163,5

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

*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	180	3721	3237	15	99	3102	3122	12	95	2341	2715
Intragrupa y off-shore***	0	0	1967	1675	0	1	1950	991	0	0	1861	779
Otros	180	27	535	1312	99	13	534	1473	95	12	428	1136
Total	207	207	6224	6224	113	113	5586	5586	107	107	4630	4630

* 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.