

Fecha de Publicación: 4 de enero de 2013

Fecha de Información: 02 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\$727,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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 | 151,3 | 88,8 | 49,0 | 98,8 | 4,8 | 17,5 | 35,0 |
| 15-35 | 115,0 | 275,7 | 220,3 | 48,0 | 29,4 | 41,0 | 26,0 |
| 36-60 | 10,7 | 23,0 | 0,0 | 0,0 | 23,0 | 10,7 | 0,0 |
| 61-90 | 55,6 | 40,5 | 0,0 | 20,0 | 25,5 | 20,6 | 15,0 |
| 91-180 | 1,5 | 33,0 | 0,0 | 0,0 | 33,0 | 1,5 | 0,0 |
| >180 | 6,0 | 2,1 | 0,0 | 5,0 | 2,1 | 1,0 | 0,0 |
| Total | 340,0 | 463,1 | 269,3 | 171,8 | 117,8 | 92,2 | 76,0 |

* 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 | 2,2 % | 3,8 % | 1,3 % | 1,9 % |
| 15-35 | 3,2 % | 2,9 % | 1,8 % | 2,7 % |
| 36-60 | - | 3,4 % | 2,6 % | 3,1 % |
| 61-90 | 3,4 % | 3,5 % | 2,8 % | 3,1 % |
| 91-180 | - | 4,1 % | 2,6 % | 4,0 % |
| >180 | - | 5,2 % | 3,2 % | 3,8 % |
| Total | 2,8 % | 3,2 % | 1,9 % | 2,7 % |

* 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 | 31 de dic. al 4 de enero | | | | 7 al 11 de enero | | | | 14 al 18 de enero | | | |
|----------------------------------|--------------------------|-----------|-------------|-------------|------------------|-----------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 2 | 28 | 1397 | 1798 | 9 | 36 | 2498 | 2689 | 17 | 86 | 2292 | 2178 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1174 | 675 | 0 | 1 | 1551 | 1102 | 0 | 0 | 1167 | 612 |
| Otros | 28 | 2 | 262 | 360 | 36 | 8 | 415 | 674 | 86 | 17 | 535 | 1204 |
| Total | 30 | 30 | 2833 | 2833 | 46 | 46 | 4465 | 4465 | 103 | 103 | 3994 | 3994 |

* 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.