

Fecha de Publicación: 9 de enero de 2013

Fecha de Información: 04 de enero de 2013¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$941,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	119,1	135,9	93,0	35,0	7,9	49,1	35,0
15-35	178,7	302,3	254,8	49,5	10,5	92,2	37,0
36-60	53,5	48,6	0,0	0,0	48,6	53,5	0,0
61-90	5,0	10,4	0,0	0,0	10,4	5,0	0,0
91-180	70,0	50,7	0,0	70,0	50,7	0,0	0,0
>180	5,0	34,4	18,0	5,0	16,4	0,0	0,0
Total	431,3	582,3	365,8	159,5	144,5	199,8	72,0

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

*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	35	1424	1824	14	38	2626	2923	26	89	2375	2362
Intragrupa y off-shore***	0	0	1204	702	0	1	1747	1155	0	0	1289	617
Otros	35	2	258	360	38	13	421	716	89	26	538	1224
Total	37	37	2886	2886	52	52	4793	4793	116	116	4203	4203

* 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.