

Fecha de Publicación: 14 de febrero de 2013

Fecha de Información: 12 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\$1359,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.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	403,4	115,1	80,9	206,9	10,2	172,5	24,0
15-35	233,6	375,9	350,5	133,0	3,4	78,6	22,0
36-60	102,5	9,0	0,0	0,0	9,0	102,5	0,0
61-90	50,3	8,0	0,0	30,0	8,0	20,3	0,0
91-180	15,2	8,8	0,0	0,0	8,8	15,2	0,0
>180	5,0	83,7	58,0	0,0	20,7	0,0	5,0
Total	810,0	600,5	489,4	369,9	60,1	389,1	51,0

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

*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	11 al 15 de febrero				18 al 22 de febrero				25 de feb. al 1 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	100	3308	3364	12	99	2728	2803	5	105	2489	2638
Intragrupa y off-shore***	0	1	2203	1140	0	0	1882	909	0	0	1583	890
Otros	100	14	523	1529	99	12	431	1329	105	5	567	1112
Total	116	116	6034	6034	111	111	5041	5041	110	110	4639	4639

* 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.