

Fecha de Publicación: 15 de febrero de 2013

Fecha de Información: 13 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\$1115,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	328,3	120,2	60,0	208,0	25,2	85,3	35,0
15-35	246,8	416,2	306,5	108,5	41,7	70,3	68,0
36-60	2,5	12,5	0,0	0,0	12,5	2,5	0,0
61-90	30,8	16,1	0,9	0,0	15,2	30,8	0,0
91-180	0,5	11,0	0,0	0,0	11,0	0,5	0,0
>180	23,3	26,7	0,3	5,0	10,4	2,3	16,0
Total	632,3	602,6	367,7	321,5	115,9	191,8	119,0

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

*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	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	94	3489	3362	12	99	2859	2877	5	105	2520	2702
Intragrupa y off-shore***	0	1	2225	1312	0	0	1920	936	0	0	1593	905
Otros	94	14	494	1534	99	12	438	1403	105	5	622	1128
Total	109	109	6208	6208	112	112	5217	5217	111	111	4735	4735

* 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.