

Fecha de Publicación: 16 de febrero de 2013

Fecha de Información: 14 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\$1544,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,3%.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	299,4	204,6	59,0	39,0	15,6	130,4	130,0
15-35	390,6	586,7	524,2	102,8	34,5	259,9	28,0
36-60	3,2	5,4	0,0	0,0	5,4	3,2	0,0
61-90	55,2	66,6	15,0	30,0	31,6	5,2	20,0
91-180	53,7	17,6	0,0	45,0	17,6	8,7	0,0
>180	11,9	32,2	20,0	0,0	7,2	6,9	5,0
Total	814,0	913,0	618,2	216,8	111,9	414,3	183,0

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

* 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	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	93	3520	3366	12	103	3005	3038	5	117	2644	2712
Intragrupa y off-shore***	0	1	2205	1312	0	0	1979	965	0	0	1593	915
Otros	93	14	487	1535	103	12	440	1420	117	5	631	1242
Total	108	108	6213	6213	116	116	5424	5424	123	123	4868	4868

* 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.