

Fecha de Publicación: 19 de febrero de 2013

Fecha de Información: 15 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\$1259,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.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	167,9	205,9	127,1	70,0	1,7	20,8	77,1
15-35	382,6	499,5	428,8	205,0	7,8	114,6	63,0
36-60	1,4	2,4	0,1	0,0	2,4	1,4	0,0
61-90	33,7	12,0	0,0	20,0	12,0	13,7	0,0
91-180	11,1	38,9	0,0	0,0	38,9	11,1	0,0
>180	8,8	35,5	20,0	0,0	15,5	8,8	0,0
Total	605,4	794,3	575,9	295,0	78,3	170,3	140,1

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

*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	95	3521	3366	12	99	3109	3197	6	117	2706	2759
Intragrupa y off-shore***	0	1	2205	1312	0	0	2086	1015	0	0	1613	935
Otros	94	14	487	1535	99	12	442	1424	117	6	632	1258
Total	110	110	6213	6213	112	112	5636	5636	123	123	4951	4951

* 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.