

Fecha de Publicación: 20 de febrero de 2013

Fecha de Información: 18 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\$88,3 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	11,9	7,7	5,0	0,0	2,7	11,9	0,0
15-35	12,0	26,3	25,5	0,0	0,8	12,0	0,0
36-60	1,5	2,3	0,0	0,0	2,3	1,5	0,0
61-90	2,0	6,2	0,0	0,0	6,2	2,0	0,0
91-180	1,0	13,5	0,0	0,0	13,5	1,0	0,0
>180	2,8	1,2	0,0	0,0	1,2	2,8	0,0
Total	31,3	57,0	30,5	0,0	26,5	31,3	0,0

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

Sector	18 al 22 de febrero				25 de feb. al 1 de marzo				4 al 8 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	102	3114	3194	6	117	2712	2766	1	132	2389	2587
Intragrupa y off-shore***	0	0	2086	1015	0	0	1618	935	0	0	1637	807
Otros	102	13	439	1429	117	6	633	1263	132	1	389	1021
Total	115	115	5639	5639	124	124	4964	4964	133	133	4415	4415

* 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.