

Fecha de Publicación: 21 de febrero de 2013

Fecha de Información: 19 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\$1116,1 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	254,4	117,5	84,0	74,5	23,5	169,9	10,0
15-35	316,4	246,0	178,5	111,8	47,5	184,7	20,0
36-60	29,1	45,6	0,0	10,0	35,6	9,1	10,0
61-90	27,0	8,4	0,0	0,0	8,4	27,0	0,0
91-180	18,3	14,7	10,0	0,0	4,7	18,3	0,0
>180	12,9	65,6	55,0	0,6	10,6	12,3	0,0
Total	658,3	497,9	327,5	196,9	130,4	421,4	40,0

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

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	99	3197	3226	7	116	2882	2816	1	127	2487	2624
Intragrupa y off-shore***	0	0	2106	1065	0	0	1650	960	0	0	1669	827
Otros	99	13	441	1453	116	7	651	1409	127	1	394	1100
Total	112	112	5744	5744	123	123	5184	5184	128	128	4551	4551

* 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.