

Fecha de Publicación: 22 de febrero de 2013

Fecha de Información: 20 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\$1726,4 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 | 488,0 | 258,3 | 105,5 | 286,0 | 11,8 | 61,0 | 141,0 |
| 15-35 | 418,9 | 537,8 | 412,0 | 160,0 | 4,8 | 137,9 | 121,0 |
| 36-60 | 2,6 | 1,0 | 0,0 | 0,0 | 1,0 | 2,6 | 0,0 |
| 61-90 | 25,7 | 25,4 | 20,8 | 10,0 | 4,6 | 15,7 | 0,0 |
| 91-180 | 34,6 | 148,8 | 125,0 | 11,0 | 3,8 | 3,5 | 20,0 |
| >180 | 50,5 | 44,9 | 10,0 | 20,0 | 6,9 | 2,5 | 28,0 |
| Total | 1020,3 | 1016,2 | 673,3 | 487,0 | 32,9 | 223,3 | 310,0 |

* 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 | 2,1 % | 3,4 % | 1,7 % | 2,1 % |
| 15-35 | 3,0 % | 3,2 % | 1,6 % | 2,5 % |
| 36-60 | - | 3,5 % | 3,2 % | 3,3 % |
| 61-90 | - | 2,2 % | 3,1 % | 2,6 % |
| 91-180 | 2,2 % | 2,3 % | 2,8 % | 2,3 % |
| >180 | 2,8 % | 2,9 % | 2,9 % | 2,8 % |
| Total | 2,5 % | 3,0 % | 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 | 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** | 14 | 107 | 3459 | 3233 | 7 | 119 | 3014 | 2978 | 1 | 127 | 2680 | 2771 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 2122 | 1326 | 0 | 0 | 1715 | 965 | 0 | 0 | 1699 | 847 |
| Otros | 107 | 14 | 432 | 1454 | 119 | 7 | 657 | 1445 | 127 | 1 | 394 | 1155 |
| Total | 121 | 121 | 6013 | 6013 | 126 | 126 | 5387 | 5387 | 128 | 128 | 4773 | 4773 |

* 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.