

Fecha de Publicación: 25 de febrero de 2013

Fecha de Información: 21 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\$1613,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	274,3	143,5	114,6	110,0	22,4	157,8	6,5
15-35	366,8	673,4	522,0	58,5	100,9	257,8	50,5
36-60	40,1	1,5	0,0	27,0	1,5	13,1	0,0
61-90	53,4	29,7	25,0	0,0	4,7	53,4	0,0
91-180	64,1	3,9	0,0	0,0	3,9	64,1	0,0
>180	19,3	8,3	0,0	0,0	0,3	11,3	8,0
Total	818,1	860,3	661,6	195,5	133,7	557,5	65,0

* 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	28,9 %	2,3 %	2,1 %	2,6 %
15-35	4,1 %	3,6 %	3,2 %	3,5 %
36-60	-	3,3 %	2,7 %	2,8 %
61-90	-	3,1 %	2,9 %	2,9 %
91-180	2,9 %	4,9 %	2,9 %	3,0 %
>180	2,9 %	3,5 %	2,6 %	2,8 %
Total	6,4 %	3,3 %	2,7 %	3,2 %

*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**	14	107	3550	3258	8	119	3098	3071	1	126	2781	2796
Intragrupa y off-shore***	0	0	2146	1396	0	0	1798	1005	0	0	1707	847
Otros	107	14	432	1474	119	8	662	1482	126	1	412	1256
Total	120	120	6128	6128	127	127	5558	5558	127	127	4900	4900

* 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.