

Fecha de Publicación: 26 de febrero de 2013

Fecha de Información: 22 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\$1250,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	223,9	280,4	111,3	73,0	79,1	60,9	90,0
15-35	298,8	298,6	241,5	106,3	4,1	139,5	53,0
36-60	33,3	9,7	0,0	0,0	9,7	33,3	0,0
61-90	50,6	12,2	0,0	0,0	12,2	50,6	0,0
91-180	39,9	34,2	0,0	0,0	14,2	19,9	20,0
>180	71,5	80,8	40,0	0,0	20,8	51,5	20,0
Total	718,0	715,8	392,8	179,3	140,0	355,7	183,0

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

* 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	84	3549	3257	9	119	3303	3283	1	126	2798	2864
Intragrupa y off-shore***	0	0	2146	1396	0	0	1909	1075	0	0	1707	850
Otros	84	14	431	1474	119	9	672	1526	126	1	480	1271
Total	98	98	6126	6126	128	128	5884	5884	128	128	4985	4985

* 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.