

Fecha de Publicación: 27 de febrero de 2013

Fecha de Información: 25 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\$1831,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,3%.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	466,4	304,7	190,0	208,0	14,7	158,4	100,0
15-35	455,5	630,2	369,8	90,0	151,5	256,5	109,0
36-60	31,2	26,2	0,0	0,0	6,2	11,2	20,0
61-90	30,7	1,3	0,0	0,0	1,3	30,7	0,0
91-180	30,0	26,3	10,0	0,0	16,3	30,0	0,0
>180	32,4	25,4	0,0	1,7	25,4	30,8	0,0
Total	1046,3	1014,1	569,8	299,7	215,3	517,6	229,0

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

* 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	25 de feb. al 1 de marzo				4 al 8 de marzo				11 al 15 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	122	3697	3512	1	126	2865	2942	13	111	1855	2625
Intragrupa y off-shore***	0	0	2029	1278	0	0	1782	855	0	0	1780	775
Otros	121	9	682	1618	126	1	482	1333	111	13	641	875
Total	130	130	6407	6407	128	128	5130	5130	124	124	4276	4276

* 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.