

Fecha de Publicación: 28 de febrero de 2013

Fecha de Información: 26 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\$1913,1 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 | 464,5 | 369,9 | 98,3 | 115,0 | 6,1 | 84,0 | 265,5 |
| 15-35 | 398,3 | 547,9 | 460,8 | 95,5 | 38,1 | 253,8 | 49,0 |
| 36-60 | 32,3 | 5,3 | 0,0 | 15,0 | 5,3 | 17,3 | 0,0 |
| 61-90 | 167,9 | 77,3 | 0,0 | 0,0 | 77,3 | 167,9 | 0,0 |
| 91-180 | 76,1 | 26,0 | 10,0 | 41,5 | 16,0 | 34,6 | 0,0 |
| >180 | 54,1 | 8,0 | 5,0 | 0,0 | 3,0 | 54,1 | 0,0 |
| Total | 1193,3 | 1034,3 | 574,0 | 267,0 | 145,8 | 611,8 | 314,5 |

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

| Sectores | 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 | 3890 | 3728 | 1 | 126 | 3038 | 3081 | 13 | 113 | 1957 | 2693 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 2090 | 1329 | 0 | 0 | 1820 | 911 | 0 | 0 | 1823 | 782 |
| Otros | 122 | 9 | 692 | 1614 | 126 | 1 | 483 | 1348 | 113 | 13 | 646 | 950 |
| Total | 131 | 131 | 6672 | 6672 | 128 | 128 | 5341 | 5341 | 126 | 126 | 4425 | 4425 |

* 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.