

Fecha de Publicación: 2 de marzo de 2013

Fecha de Información: 28 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\$1049,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	106,5	91,9	47,8	36,0	15,8	42,2	28,3
15-35	409,4	336,4	204,3	58,0	50,2	269,5	81,9
36-60	22,4	9,0	0,0	0,0	9,0	22,4	0,0
61-90	29,9	14,4	0,0	0,0	14,4	29,9	0,0
91-180	37,1	13,5	0,0	0,0	13,5	37,1	0,0
>180	35,7	70,6	37,0	7,6	16,1	10,5	17,6
Total	640,9	535,8	289,0	101,6	119,1	411,6	127,7

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

*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	115	4131	3804	2	127	3105	3167	13	113	2076	2777
Intragrupa y off-shore***	0	0	2122	1534	0	0	1867	931	0	0	1846	782
Otros	115	9	700	1614	127	2	495	1369	113	13	650	1013
Total	124	124	6952	6952	129	129	5467	5467	125	125	4571	4571

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.