

Fecha de Publicación: 5 de marzo de 2013

Fecha de Información: 01 de marzo 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\$991,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,1%.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 | 194,3 | 123,4 | 64,8 | 41,3 | 8,7 | 103,1 | 50,0 |
| 15-35 | 284,6 | 420,9 | 349,5 | 125,0 | 27,4 | 115,6 | 44,0 |
| 36-60 | 4,4 | 1,4 | 0,0 | 0,0 | 1,4 | 4,4 | 0,0 |
| 61-90 | 16,3 | 10,3 | 0,0 | 0,0 | 10,3 | 16,3 | 0,0 |
| 91-180 | 11,4 | 7,2 | 0,0 | 0,0 | 7,2 | 11,4 | 0,0 |
| >180 | 10,1 | 1,4 | 0,0 | 0,0 | 1,4 | 10,1 | 0,0 |
| Total | 521,1 | 564,5 | 414,3 | 166,3 | 56,3 | 260,9 | 94,0 |

* 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 | 4,1 % | 3,7 % | 25,8 % | 17,2 % |
| 15-35 | 3,6 % | 3,4 % | 2,8 % | 3,3 % |
| 36-60 | - | 3,5 % | 2,3 % | 2,6 % |
| 61-90 | - | 3,6 % | 2,8 % | 3,1 % |
| 91-180 | - | 3,8 % | 2,4 % | 2,9 % |
| >180 | - | 3,1 % | 2,3 % | 2,4 % |
| Total | 3,9 % | 3,5 % | 11,6 % | 7,1 % |

* 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 | 116 | 4131 | 3786 | 4 | 130 | 3217 | 3242 | 28 | 113 | 2139 | 2820 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 2122 | 1534 | 0 | 0 | 1917 | 953 | 0 | 0 | 1861 | 801 |
| Otros | 116 | 9 | 682 | 1614 | 130 | 4 | 496 | 1435 | 113 | 28 | 653 | 1031 |
| Total | 126 | 126 | 6934 | 6934 | 134 | 134 | 5629 | 5629 | 141 | 141 | 4653 | 4653 |

* 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.