

Fecha de Publicación: 6 de marzo de 2013

Fecha de Información: 04 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\$1095,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	251,4	187,6	115,0	116,9	4,5	66,4	68,1
15-35	235,5	283,6	226,5	49,5	26,1	155,0	31,0
36-60	62,8	81,6	5,0	4,5	76,6	58,3	0,0
61-90	12,8	1,7	0,0	0,0	1,7	12,8	0,0
91-180	19,8	29,5	20,0	0,0	9,5	19,8	0,0
>180	0,4	28,1	0,0	0,0	28,1	0,4	0,0
Total	582,5	612,1	366,5	170,9	146,6	312,5	99,1

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

* 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

Sectores	4 al 8 de marzo				11 al 15 de marzo				18 al 22 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	129	3322	3297	28	109	2205	2931	11	201	3071	3561
Intragrupa y off-shore***	0	0	1948	1008	0	1	1938	806	0	0	2562	844
Otros	129	10	500	1466	109	26	657	1062	201	11	470	1698
Total	139	139	5770	5770	137	137	4799	4799	212	212	6103	6103

* 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.