

Fecha de Publicación: 7 de marzo de 2013

Fecha de Información: 05 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\$1139,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	129,1	72,1	68,8	102,8	3,4	26,4	0,0
15-35	312,8	400,8	267,0	134,3	88,5	133,2	45,4
36-60	81,4	83,4	0,0	0,0	83,4	81,4	0,0
61-90	11,9	16,0	0,0	0,0	16,0	11,9	0,0
91-180	31,6	30,9	15,0	0,0	5,9	21,6	10,0
>180	3,5	21,3	10,0	1,0	11,3	2,4	0,0
Total	570,2	624,6	360,8	238,0	208,5	276,8	55,4

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

* 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	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	131	3401	3323	28	116	2245	2963	11	212	3095	3586
Intragrupa y off-shore***	0	0	1974	1085	0	1	1975	832	0	0	2583	859
Otros	131	10	500	1467	116	26	652	1077	212	11	474	1707
Total	141	141	5874	5874	143	143	4872	4872	223	223	6152	6152

* 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.