

Fecha de Publicación: 8 de marzo de 2013

Fecha de Información: 06 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\$987,9 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	166,3	77,8	3,8	46,0	4,1	50,3	70,0
15-35	334,9	439,4	338,3	39,0	10,1	204,9	91,0
36-60	0,0	5,2	0,0	0,0	5,2	0,0	0,0
61-90	36,0	26,7	20,0	0,0	6,7	36,0	0,0
91-180	17,7	14,3	0,0	0,0	14,3	17,7	0,0
>180	4,2	26,3	0,0	0,0	26,3	4,2	0,0
Total	559,1	589,7	362,0	85,0	66,7	313,1	161,0

* 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	2,9 %	4,2 %	2,0 %	2,5 %
15-35	3,2 %	3,4 %	3,1 %	3,2 %
36-60	-	3,6 %	-	3,6 %
61-90	-	2,0 %	3,0 %	2,6 %
91-180	-	3,1 %	2,8 %	2,9 %
>180	-	2,9 %	2,3 %	2,8 %
Total	3,0 %	3,3 %	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	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	101	3471	3353	28	119	2298	3005	11	215	3150	3677
Intragrupa y off-shore***	0	0	1974	1131	0	1	1979	832	0	0	2629	859
Otros	101	10	530	1491	119	27	655	1095	215	11	469	1712
Total	111	111	5975	5975	147	147	4932	4932	226	226	6248	6248

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