

Fecha de Publicación: 11 de marzo de 2013

Fecha de Información: 07 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\$1521,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	397,8	223,2	125,7	309,5	32,5	23,3	65,0
15-35	426,9	462,1	404,5	23,2	8,6	354,7	49,0
36-60	2,8	10,4	3,0	0,0	7,4	2,8	0,0
61-90	0,7	12,5	0,0	0,0	12,5	0,7	0,0
91-180	41,0	6,8	0,0	40,0	6,8	1,0	0,0
>180	36,3	34,9	0,0	13,0	14,9	3,3	20,0
Total	905,5	749,9	533,2	385,7	82,8	385,8	134,0

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

*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**	11	99	3660	3417	29	119	2465	3121	12	215	3191	3725
Intragrupa y off-shore***	0	0	1975	1250	0	1	2069	992	0	0	2667	892
Otros	99	11	528	1496	119	28	680	1102	215	12	480	1720
Total	110	110	6164	6164	148	148	5214	5214	227	227	6338	6338

* 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.