

Fecha de Publicación: 12 de marzo de 2013

Fecha de Información: 08 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\$1168,2 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	162,6	182,4	100,3	38,8	72,1	113,8	10,0
15-35	340,8	364,6	253,7	84,5	51,9	197,3	59,0
36-60	1,8	9,1	0,0	0,0	9,1	1,8	0,0
61-90	44,0	60,1	0,0	20,0	50,1	14,0	10,0
91-180	31,7	31,6	0,9	0,0	10,8	11,7	20,0
>180	15,9	22,5	5,0	15,0	17,5	0,9	0,0
Total	596,9	670,3	359,8	158,3	211,5	339,6	99,0

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

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**	11	99	3660	3417	30	130	2569	3177	12	214	3249	3837
Intragrupa y off-shore***	0	0	1975	1250	5	1	2125	1031	0	0	2706	892
Otros	99	11	528	1496	125	29	681	1167	214	12	542	1768
Total	110	110	6164	6164	160	160	5375	5375	226	226	6497	6497

* 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.