

Fecha de Publicación: 13 de marzo de 2013

Fecha de Información: 11 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\$822,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	231,0	257,8	143,0	98,0	43,8	62,0	71,0
15-35	194,4	95,2	37,0	124,0	42,2	54,4	16,0
36-60	6,2	44,1	20,0	0,0	24,1	6,2	0,0
61-90	7,1	4,8	0,0	0,0	4,8	7,1	0,0
91-180	22,4	19,0	0,0	0,0	14,0	17,4	5,0
>180	0,5	32,5	0,0	0,0	32,5	0,5	0,0
Total	461,4	453,4	200,0	222,0	161,4	147,4	92,0

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

*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	11 al 15 de marzo				18 al 22 de marzo				25 al 29 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	124	2731	3277	12	254	3317	3954	2	34	667	786
Intragruppo y off-shore***	5	1	2185	1129	0	0	2789	892	0	0	344	47
Otros	119	29	683	1193	254	12	544	1803	34	2	129	308
Total	154	154	5599	5599	266	266	6649	6649	36	36	1140	1140

* 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.