

Fecha de Publicación: 14 de marzo de 2013

Fecha de Información: 12 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\$1359,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.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	505,8	284,1	174,4	194,4	15,7	217,4	94,0
15-35	171,4	299,7	172,5	88,0	61,2	17,4	66,0
36-60	65,5	72,4	10,0	5,0	52,4	50,5	10,0
61-90	17,9	3,7	0,0	0,0	3,7	17,9	0,0
91-180	13,4	66,2	0,0	0,0	66,2	13,4	0,0
>180	23,6	5,5	0,0	0,0	5,5	23,6	0,0
Total	797,6	731,5	356,9	287,4	204,6	340,2	170,0

* 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	18,2 %	3,6 %	5,4 %	7,2 %
15-35	3,2 %	4,0 %	3,3 %	3,7 %
36-60	3,4 %	3,8 %	3,1 %	3,4 %
61-90	-	3,6 %	3,3 %	3,3 %
91-180	-	3,4 %	3,1 %	3,4 %
>180	-	4,2 %	3,0 %	3,2 %
Total	11,5 %	3,8 %	4,6 %	5,3 %

*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	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	122	3110	3437	13	261	3439	4057	2	34	670	801
Intragrupa y off-shore***	5	1	2285	1288	0	0	2849	927	0	0	359	47
Otros	117	30	689	1358	261	13	547	1849	34	2	129	311
Total	153	153	6084	6084	274	274	6834	6834	36	36	1159	1159

* 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.