

Fecha de Publicación: 15 de marzo de 2013

Fecha de Información: 13 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\$1129,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	340,8	203,5	60,0	94,0	13,5	116,8	130,0
15-35	309,6	391,0	202,8	106,4	62,2	77,2	126,0
36-60	7,0	13,8	0,8	5,0	12,9	2,0	0,0
61-90	8,1	11,4	0,0	0,0	11,4	8,1	0,0
91-180	1,0	12,0	0,0	0,0	12,0	1,0	0,0
>180	41,5	71,2	15,0	10,0	31,2	6,5	25,0
Total	708,1	702,8	278,6	215,4	143,3	211,7	281,0

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

* 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	124	3299	3492	15	265	3552	4177	2	34	698	829
Intragrupa y off-shore***	5	1	2285	1360	0	0	2909	949	0	0	359	47
Otros	119	30	704	1436	265	15	545	1879	34	2	129	311
Total	154	154	6288	6288	280	280	7005	7005	36	36	1187	1187

* 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.