

Fecha de Publicación: 19 de marzo de 2013

Fecha de Información: 15 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\$1123,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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	265,0	70,1	35,0	86,3	15,0	158,7	20,0
15-35	233,9	428,2	395,7	64,0	3,2	140,6	29,3
36-60	6,7	9,6	0,0	0,0	9,6	6,7	0,0
61-90	9,0	26,8	20,0	0,0	6,8	9,0	0,0
91-180	38,1	17,3	0,0	0,0	17,3	38,1	0,0
>180	40,1	41,4	5,0	25,0	23,4	2,1	13,0
Total	592,7	593,4	455,7	175,3	75,4	355,2	62,3

* 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	12,3 %	3,6 %	2,2 %	3,2 %
15-35	3,6 %	4,0 %	3,3 %	3,7 %
36-60	-	3,5 %	2,6 %	3,2 %
61-90	-	3,4 %	3,0 %	3,3 %
91-180	-	3,3 %	3,1 %	3,2 %
>180	3,1 %	3,2 %	3,0 %	3,1 %
Total	6,3 %	3,9 %	2,8 %	3,5 %

* 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	3411	3495	17	284	3925	4386	4	36	812	934
Intragrupa y off-shore***	5	1	2289	1421	0	0	2982	1036	0	0	374	62
Otros	117	30	702	1487	284	17	586	2071	36	4	130	320
Total	153	153	6403	6403	301	301	7493	7493	39	39	1316	1316

* 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.