

Fecha de Publicación: 20 de marzo de 2013

Fecha de Información: 18 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\$1280,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	219,2	111,7	47,0	135,0	3,7	23,2	61,0
15-35	310,5	622,7	480,0	43,0	60,2	185,0	82,5
36-60	33,0	35,8	0,0	0,1	10,8	7,9	25,0
61-90	1,5	1,9	0,0	0,0	1,9	1,5	0,0
91-180	6,7	13,3	4,2	0,2	7,9	5,3	1,2
>180	62,7	58,5	3,0	15,0	28,5	20,7	27,0
Total	633,6	843,9	534,2	193,3	113,0	243,6	196,7

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

*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	18 al 22 de marzo				25 al 29 de marzo				1 al 5 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	288	4100	4441	3	33	851	968	3	83	2807	2434
Intragrupa y off-shore***	0	0	3006	1171	0	0	374	62	0	0	1421	659
Otros	288	19	586	2081	33	3	132	328	83	3	582	1717
Total	307	307	7692	7692	36	36	1357	1357	86	86	4810	4810

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.