

Fecha de Publicación: 21 de marzo de 2013

Fecha de Información: 19 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\$822,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	141,5	94,2	90,0	129,0	4,2	12,5	0,0
15-35	238,9	264,0	219,6	109,0	25,7	111,2	18,7
36-60	4,8	7,0	0,0	0,0	7,0	4,8	0,0
61-90	14,7	5,1	0,0	0,0	5,1	14,7	0,0
91-180	6,0	6,0	0,0	0,0	6,0	6,0	0,0
>180	47,2	21,5	0,0	0,0	11,5	37,2	10,0
Total	453,2	397,8	309,6	238,0	59,5	186,5	28,7

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

*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**	18	291	4237	4532	3	32	853	967	3	83	2810	2448
Intragrupa y off-shore***	0	0	3096	1300	0	0	374	62	0	0	1435	659
Otros	291	18	587	2088	32	3	132	330	83	3	582	1720
Total	310	310	7919	7919	36	36	1358	1358	86	86	4827	4827

* 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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.