

Fecha de Publicación: 22 de marzo de 2013

Fecha de Información: 20 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\$2036,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	712,2	328,0	171,4	520,1	2,7	38,1	154,0
15-35	307,2	749,6	619,3	115,3	32,3	93,9	98,0
36-60	8,4	27,5	20,0	0,0	7,5	8,4	0,0
61-90	22,1	5,1	0,0	0,8	5,1	21,3	0,0
91-180	33,0	7,5	1,2	20,0	6,3	13,0	0,0
>180	77,4	20,1	5,0	50,0	5,1	17,4	10,0
Total	1160,3	1137,8	816,8	706,1	59,0	192,2	262,0

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

*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

Sectores	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	294	4761	4734	4	34	946	1026	3	84	2977	2624
Intragrupa y off-shore***	0	0	3240	1759	0	0	401	123	0	0	1535	713
Otros	294	19	581	2090	34	4	133	332	84	3	583	1758
Total	313	313	8582	8582	38	38	1480	1480	87	87	5095	5095

* 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.