

Fecha de Publicación: 27 de marzo de 2013

Fecha de Información: 22 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\$1646,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.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	147,4	11,2	0,0	70,0	11,2	77,4	0,0
15-35	637,6	743,1	627,0	174,5	1,1	348,1	115,0
36-60	15,8	42,4	40,0	0,0	2,4	15,8	0,0
61-90	46,6	20,8	0,0	10,0	10,8	26,6	10,0
91-180	27,3	4,1	0,0	2,2	4,1	25,1	0,0
>180	54,7	20,0	0,0	2,0	20,0	52,8	0,0
Total	929,4	841,6	667,0	258,7	49,6	545,7	125,0

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

*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	277	5023	4740	4	37	1019	1084	7	83	3238	2687
Intragrupa y off-shore***	0	0	3245	2007	0	0	411	180	0	0	1552	753
Otros	277	19	562	2084	37	4	162	328	83	7	610	1958
Total	296	296	8831	8831	40	40	1592	1592	89	89	5399	5399

* 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.