

Fecha de Publicación: 28 de marzo de 2013

Fecha de Información: 26 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\$1073,6 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	138,5	24,1	20,0	63,0	4,1	75,5	0,0
15-35	263,2	428,2	316,2	120,0	57,0	88,2	55,0
36-60	50,3	14,4	0,0	0,0	14,4	50,3	0,0
61-90	8,3	31,7	10,0	0,0	21,7	8,3	0,0
91-180	15,7	37,9	15,0	0,0	22,9	15,7	0,0
>180	33,7	102,5	60,0	0,0	22,5	13,7	20,0
Total	509,8	638,8	421,2	183,0	142,6	251,8	75,0

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

Sector	25 al 29 de marzo				1 al 5 de abril				8 al 12 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	6	37	1012	1085	9	84	3357	2708	10	141	1888	2254
Intragrupa y off-shore***	0	0	411	180	0	0	1572	816	0	0	1435	472
Otros	37	6	163	320	84	9	610	2015	141	10	603	1200
Total	43	43	1585	1585	93	93	5539	5539	151	151	3925	3925

* 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.