

Fecha de Publicación: 2 de abril de 2013

Fecha de Información: 27 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\$826,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	256,0	234,1	118,0	59,5	17,1	97,5	99,0
15-35	256,3	177,4	61,4	175,5	58,0	22,8	58,0
36-60	3,2	3,6	0,0	0,0	3,6	3,2	0,0
61-90	13,8	13,3	0,0	10,0	13,3	3,8	0,0
91-180	6,1	2,9	0,0	0,0	2,9	6,1	0,0
>180	11,0	6,0	5,0	0,0	1,0	11,0	0,0
Total	546,5	437,3	184,4	245,0	95,9	144,5	157,0

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

*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	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	39	1011	1084	9	87	3477	2938	13	140	2023	2257
Intragrupa y off-shore***	0	0	411	180	0	0	1690	820	0	0	1438	528
Otros	39	6	161	319	87	9	623	2032	140	13	603	1279
Total	45	45	1583	1583	97	97	5790	5790	153	153	4064	4064

* 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.