

Fecha de Publicación: 3 de abril de 2013

Fecha de Información: 01 de abril 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\$1458,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.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	206,0	159,9	152,0	139,7	1,9	60,3	6,0
15-35	474,3	381,6	266,0	297,3	62,6	124,0	53,0
36-60	60,8	22,4	15,0	50,0	7,4	10,8	0,0
61-90	46,2	75,5	35,0	0,0	30,5	36,2	10,0
91-180	0,1	11,4	0,0	0,0	11,4	0,1	0,0
>180	14,4	84,4	20,0	0,0	54,4	4,4	10,0
Total	801,8	735,2	488,0	487,0	168,2	235,8	79,0

* 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	18,6 %	2,7 %	2,6 %	2,9 %
15-35	3,1 %	2,2 %	1,7 %	2,0 %
36-60	-	3,2 %	3,1 %	3,1 %
61-90	2,9 %	3,1 %	3,0 %	3,1 %
91-180	-	3,4 %	2,0 %	3,4 %
>180	2,4 %	2,8 %	2,8 %	2,7 %
Total	4,2 %	2,6 %	2,2 %	2,5 %

*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	1 al 5 de abril				8 al 12 de abril				15 al 19 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	88	3579	3050	20	140	2106	2300	9	103	1700	2590
Intragrupa y off-shore***	0	0	1802	875	0	0	1478	604	0	0	1935	692
Otros	88	12	621	2076	140	20	603	1282	103	9	377	730
Total	100	100	6001	6001	159	159	4186	4186	112	112	4012	4012

* 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.