

Fecha de Publicación: 4 de abril de 2013

Fecha de Información: 02 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\$1575,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	377,1	303,2	25,0	61,2	56,2	94,0	222,0
15-35	486,9	369,7	209,4	232,5	83,3	177,4	77,0
36-60	102,4	127,0	70,0	0,0	57,0	102,4	0,0
61-90	0,3	23,1	0,0	0,0	23,1	0,3	0,0
91-180	15,5	22,0	10,0	15,0	12,0	0,5	0,0
>180	4,6	43,0	10,0	0,0	33,0	4,6	0,0
Total	986,8	888,1	324,4	308,7	264,7	379,1	299,0

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

*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	92	3754	3198	22	140	2271	2399	11	113	1776	2661
Intragrupa y off-shore***	0	0	1810	915	0	1	1495	624	0	0	1935	712
Otros	92	12	637	2088	140	21	616	1358	113	11	398	736
Total	104	104	6200	6200	162	162	4382	4382	124	124	4109	4109

* 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.