

Fecha de Publicación: 9 de abril de 2013

Fecha de Información: 05 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\$1221,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	389,7	208,1	80,0	76,0	37,1	222,7	91,0
15-35	416,0	230,9	186,0	183,6	6,9	194,4	38,0
36-60	1,5	33,3	0,0	0,0	33,3	1,5	0,0
61-90	3,0	7,8	0,0	0,0	7,8	3,0	0,0
91-180	2,1	30,8	0,0	0,5	30,8	1,6	0,0
>180	21,6	25,1	0,0	0,0	5,1	1,6	20,0
Total	834,0	536,0	266,0	260,1	121,0	424,9	149,0

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

* 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	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**	13	100	4005	3277	31	141	2759	2890	14	114	2224	2780
Intragrupa y off-shore***	0	0	1872	1160	0	1	1814	848	0	0	1938	784
Otros	100	13	649	2089	141	30	670	1504	114	14	442	1040
Total	113	113	6526	6526	172	172	5242	5242	129	129	4604	4604

* 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.