

Fecha de Publicación: 10 de abril de 2013

Fecha de Información: 08 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\$1006,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	378,6	142,7	27,0	86,0	34,7	211,6	81,0
15-35	243,8	179,6	136,0	137,0	12,6	75,8	31,0
36-60	87,9	34,5	0,7	0,0	33,8	87,9	0,0
61-90	0,0	2,5	0,0	0,0	2,5	0,0	0,0
91-180	0,0	42,7	0,0	0,0	42,7	0,0	0,0
>180	0,7	5,8	0,0	0,0	5,8	0,7	0,0
Total	711,0	407,9	163,7	223,0	132,2	376,0	112,0

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

*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	8 al 12 de abril				15 al 19 de abril				22 al 26 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	141	2939	3005	15	119	2360	2792	18	104	1811	2490
Intragrupa y off-shore***	0	1	1831	934	0	0	1938	784	0	0	1717	470
Otros	141	32	703	1533	119	15	440	1161	104	18	491	1060
Total	174	174	5472	5472	134	134	4738	4738	122	122	4020	4020

* 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.