

Fecha de Publicación: 11 de abril de 2013

Fecha de Información: 09 de abril de 2013¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1425,4 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	278,2	170,9	147,6	200,3	23,3	77,9	0,0
15-35	348,3	328,9	236,5	131,5	14,6	139,0	77,8
36-60	41,2	91,7	40,0	0,0	46,7	36,2	5,0
61-90	57,0	19,9	0,0	0,0	19,9	57,0	0,0
91-180	20,0	51,2	0,3	0,0	30,9	0,0	20,0
>180	75,5	120,4	0,4	0,0	45,0	0,5	75,0
Total	820,2	783,0	424,8	331,8	180,4	310,6	177,8

* 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	-	2,5 %	2,0 %	2,2 %
15-35	1,3 %	3,1 %	2,4 %	2,4 %
36-60	2,9 %	3,3 %	2,9 %	3,1 %
61-90	-	3,4 %	3,0 %	3,1 %
91-180	3,0 %	3,3 %	-	3,2 %
>180	3,0 %	3,1 %	2,6 %	3,0 %
Total	2,2 %	2,9 %	2,3 %	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	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**	32	140	3138	3116	15	119	2432	2843	18	106	1835	2504
Intragrupa y off-shore***	0	1	1930	1124	0	0	1986	794	0	0	1717	490
Otros	140	31	714	1542	119	15	442	1223	106	18	505	1065
Total	173	173	5782	5782	135	135	4860	4860	124	124	4058	4058

* 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.