

Fecha de Publicación: 12 de abril de 2013

Fecha de Información: 10 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\$2076,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	573,7	163,8	109,3	363,5	22,5	178,2	32,0
15-35	407,7	737,3	620,0	135,3	64,3	219,4	53,0
36-60	60,2	35,6	10,0	0,0	25,6	60,2	0,0
61-90	7,5	8,7	0,0	0,0	8,7	7,5	0,0
91-180	65,4	27,5	10,0	0,0	17,5	65,4	0,0
>180	36,8	62,4	10,0	10,0	27,4	1,8	25,0
Total	1151,2	1035,3	759,3	508,8	166,0	532,4	110,0

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

*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	122	3523	3166	16	118	2622	2910	19	106	1834	2579
Intragrupa y off-shore***	0	1	1954	1478	0	0	2006	803	0	0	1790	490
Otros	122	31	740	1573	118	16	457	1372	106	19	507	1063
Total	155	155	6217	6217	134	134	5086	5086	124	124	4131	4131

* 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.