

Fecha de Publicación: 13 de abril de 2013

Fecha de Información: 11 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\$1016,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	153,7	298,0	193,0	40,6	105,0	113,1	0,0
15-35	179,3	258,2	170,5	49,3	42,6	84,9	45,1
36-60	71,1	21,0	0,0	0,0	21,0	71,1	0,0
61-90	17,5	29,8	0,0	0,0	14,8	2,5	15,0
91-180	6,6	3,7	0,0	0,0	3,7	6,6	0,0
>180	35,1	22,1	0,0	10,0	2,1	5,1	20,0
Total	463,3	632,9	363,5	99,9	189,3	283,3	80,1

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

* 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**	31	121	3549	3169	17	126	2712	3093	19	107	1879	2681
Intragrupa y off-shore***	0	1	1958	1498	0	0	2096	824	0	0	1890	490
Otros	121	30	739	1578	126	17	551	1441	107	19	509	1109
Total	153	153	6246	6246	143	143	5359	5359	125	125	4279	4279

* 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.