

Fecha de Publicación: 17 de abril de 2013

Fecha de Información: 15 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\$974,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.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	209,8	328,9	243,0	108,0	65,9	81,8	20,0
15-35	191,8	236,4	106,8	26,5	50,6	86,3	79,0
36-60	42,1	27,5	0,0	0,0	7,5	22,1	20,0
61-90	8,2	0,5	0,0	0,0	0,5	8,2	0,0
91-180	12,5	2,3	0,0	0,0	2,3	12,5	0,0
>180	19,6	14,3	0,0	0,7	14,3	18,9	0,0
Total	483,9	609,9	349,8	135,2	141,1	229,7	119,0

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

*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	15 al 19 de abril				22 al 26 de abril				29 de abr. al 3 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	127	2871	3426	20	106	2139	3051	7	66	2066	1757
Intragrupa y off-shore***	0	0	2303	933	0	0	2133	555	0	0	993	726
Otros	127	19	626	1441	106	20	602	1267	66	7	405	980
Total	146	146	5801	5801	125	125	4874	4874	73	73	3463	3463

* 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.