

Fecha de Publicación: 18 de abril de 2013

Fecha de Información: 16 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\$2074,4 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	628,9	76,5	46,0	401,0	30,5	227,9	0,0
15-35	373,6	726,5	607,9	245,0	24,5	34,5	94,1
36-60	80,4	109,3	20,0	0,0	89,3	80,4	0,0
61-90	14,4	8,2	2,7	0,0	5,5	14,4	0,0
91-180	0,6	32,5	25,0	0,2	7,5	0,4	0,0
>180	33,7	113,8	80,0	0,0	3,8	3,7	30,0
Total	1131,6	1066,8	781,6	646,2	161,2	361,3	124,1

* 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	-	3,1 %	2,5 %	2,6 %
15-35	3,6 %	3,1 %	2,7 %	3,0 %
36-60	-	3,3 %	2,9 %	3,2 %
61-90	-	3,5 %	1,2 %	1,8 %
91-180	-	3,3 %	2,5 %	3,3 %
>180	3,0 %	3,0 %	2,7 %	3,0 %
Total	3,4 %	3,1 %	2,6 %	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	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**	20	125	3300	3437	19	106	2317	3120	7	65	2137	1850
Intragrupa y off-shore***	0	0	2306	1319	0	0	2176	570	0	0	1085	777
Otros	125	20	634	1484	106	19	629	1431	65	7	406	1001
Total	145	145	6240	6240	125	125	5122	5122	72	72	3628	3628

* 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.