

Fecha de Publicación: 19 de abril de 2013

Fecha de Información: 17 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\$2288,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	442,4	260,0	42,0	282,0	133,0	75,4	85,0
15-35	566,9	750,4	569,8	135,0	13,1	264,4	167,5
36-60	31,6	4,4	0,0	0,0	4,4	31,6	0,0
61-90	10,1	121,8	115,0	0,0	1,8	5,1	5,0
91-180	95,2	111,1	10,0	5,0	101,1	90,2	0,0
>180	123,9	68,5	14,7	20,0	13,8	63,9	40,0
Total	1270,2	1316,2	751,5	442,0	267,3	530,7	297,5

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

*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	112	3579	3494	20	106	2445	3179	8	65	2204	2032
Intragrupa y off-shore***	0	0	2306	1533	0	0	2218	638	0	0	1125	777
Otros	112	19	636	1495	106	20	645	1491	65	8	518	1038
Total	131	131	6522	6522	126	126	5309	5309	73	73	3846	3846

* 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.