

Fecha de Publicación: 20 de abril de 2013

Fecha de Información: 18 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\$1913,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	276,8	96,5	14,7	195,0	41,8	41,8	40,0
15-35	585,2	846,2	691,5	154,0	12,7	289,2	142,0
36-60	80,6	111,9	0,0	0,0	111,9	80,6	0,0
61-90	7,5	14,0	10,0	0,0	4,0	7,5	0,0
91-180	28,7	9,6	1,3	0,0	8,3	28,7	0,0
>180	11,6	26,8	20,0	0,0	6,8	11,6	0,0
Total	990,3	1104,9	737,5	349,0	185,5	459,3	182,0

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

Sectores	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	113	3662	3497	22	108	2607	3249	8	66	2239	2081
Intragruppo y off-shore***	0	0	2310	1613	0	0	2226	743	0	0	1148	787
Otros	113	20	635	1498	108	22	682	1523	66	8	519	1038
Total	133	133	6608	6608	130	130	5515	5515	74	74	3906	3906

* 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.