

Fecha de Publicación: 24 de abril de 2013

Fecha de Información: 22 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\$1390,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.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	243,0	166,6	136,0	130,0	2,6	85,0	28,0
15-35	501,2	437,0	328,0	327,6	18,0	82,6	91,0
36-60	55,4	6,1	0,0	0,0	6,1	55,4	0,0
61-90	1,4	0,9	0,0	0,0	0,9	1,4	0,0
91-180	4,2	61,2	50,2	0,0	11,1	4,2	0,0
>180	19,4	18,2	10,0	0,0	3,2	14,4	5,0
Total	824,5	690,0	524,2	457,6	41,9	242,9	124,0

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

*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	22 al 26 de abril				29 de abr. al 3 de mayo				6 al 10 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	110	2956	3508	9	66	2328	2162	8	74	2846	3231
Intragrupa y off-shore***	0	0	2294	974	0	0	1221	787	0	0	2359	1022
Otros	110	24	785	1553	66	9	527	1127	74	8	453	1405
Total	134	134	6035	6035	76	76	4076	4076	83	83	5658	5658

* 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.