

Fecha de Publicación: 25 de abril de 2013

Fecha de Información: 23 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\$1181,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	317,5	127,0	91,5	187,5	17,5	112,0	18,0
15-35	275,2	294,9	196,3	148,0	3,1	31,7	95,5
36-60	31,5	123,0	80,0	17,5	33,0	4,0	10,0
61-90	0,1	2,5	0,0	0,0	2,5	0,1	0,0
91-180	14,1	54,6	50,0	0,0	4,6	14,1	0,0
>180	28,9	60,7	10,0	0,0	25,7	3,9	25,0
Total	667,3	662,7	427,8	353,0	86,4	165,9	148,5

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

*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**	23	112	3158	3534	10	68	2438	2245	8	74	2872	3292
Intragrupa y off-shore***	0	0	2318	1149	0	0	1282	795	0	0	2403	1027
Otros	112	23	787	1579	68	10	531	1211	74	8	453	1409
Total	135	135	6263	6263	79	79	4251	4251	82	82	5728	5728

* 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.