

Fecha de Publicación: 26 de abril de 2013

Fecha de Información: 24 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\$1532,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	192,7	190,9	81,5	62,6	49,4	70,1	60,0
15-35	452,0	255,3	215,8	214,0	2,5	201,0	37,0
36-60	97,2	91,0	30,4	90,3	55,6	1,9	5,0
61-90	36,2	121,9	115,0	29,5	6,9	6,7	0,0
91-180	26,9	92,2	76,2	20,0	16,1	6,9	0,0
>180	13,5	75,1	64,0	0,0	1,1	3,5	10,0
Total	818,5	826,3	582,8	416,4	131,5	290,1	112,0

* 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	3,2 %	2,1 %	2,0 %	2,3 %
15-35	2,6 %	3,3 %	2,7 %	2,9 %
36-60	3,2 %	2,9 %	2,6 %	2,8 %
61-90	-	2,7 %	2,9 %	2,8 %
91-180	-	3,2 %	3,2 %	3,2 %
>180	3,1 %	3,2 %	2,9 %	3,2 %
Total	3,0 %	2,9 %	2,6 %	2,8 %

*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	116	3239	3603	10	69	2513	2366	9	72	3034	3318
Intragrupa y off-shore***	0	0	2342	1176	0	0	1340	816	0	0	2403	1041
Otros	116	23	788	1588	69	10	579	1249	72	9	479	1556
Total	140	140	6368	6368	79	79	4431	4431	81	81	5916	5916

* 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.