

Fecha de Publicación: 29 de abril de 2013

Fecha de Información: 25 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\$1712,1 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	460,1	203,9	61,3	359,3	60,7	18,8	82,0
15-35	540,9	585,0	477,0	340,0	28,0	120,9	80,0
36-60	2,9	12,5	0,7	0,0	11,8	2,9	0,0
61-90	9,4	8,7	0,0	0,0	8,7	9,4	0,0
91-180	4,7	35,0	10,4	0,3	24,0	3,8	0,6
>180	0,1	11,5	10,0	0,0	1,5	0,1	0,0
Total	1018,1	856,7	559,4	699,6	134,7	155,9	162,6

* 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	2,8 %	3,2 %	0,9 %	1,6 %
15-35	2,6 %	3,1 %	2,9 %	2,9 %
36-60	-	3,4 %	2,5 %	3,2 %
61-90	-	3,4 %	2,9 %	3,2 %
91-180	3,0 %	3,0 %	2,5 %	3,0 %
>180	-	3,2 %	1,4 %	3,2 %
Total	2,7 %	3,1 %	2,0 %	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**	22	116	3586	3668	11	67	2600	2450	9	75	3060	3454
Intragrupa y off-shore***	0	0	2369	1481	0	0	1374	843	0	0	2485	1068
Otros	116	22	790	1595	67	11	582	1263	75	9	533	1556
Total	138	138	6745	6745	77	77	4556	4556	84	84	6078	6078

* 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.