

Fecha de Publicación: 1 de mayo de 2013

Fecha de Información: 29 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\$1234,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	215,9	225,2	45,0	94,0	100,7	42,5	79,5
15-35	495,6	285,6	82,5	252,0	31,7	72,1	171,5
36-60	92,2	82,3	0,7	20,0	81,6	72,2	0,0
61-90	6,0	14,9	0,0	0,0	14,9	6,0	0,0
91-180	5,0	13,0	0,0	0,0	13,0	5,0	0,0
>180	10,0	49,5	25,0	0,0	14,5	0,0	10,0
Total	824,7	670,5	153,1	366,0	256,4	197,8	261,0

* 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	2,7 %	3,0 %	1,6 %	2,5 %
15-35	2,5 %	3,2 %	2,6 %	2,7 %
36-60	-	3,0 %	2,8 %	2,9 %
61-90	-	3,3 %	2,9 %	3,2 %
91-180	-	3,3 %	2,9 %	3,2 %
>180	3,2 %	3,3 %	-	3,2 %
Total	2,6 %	3,1 %	2,5 %	2,7 %

*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	29 de abr. al 3 de mayo				6 al 10 de mayo				13 al 17 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	73	2825	2610	9	78	3285	3724	9	97	1781	2303
Intragrupa y off-shore***	0	0	1468	1004	0	0	2535	1118	0	0	1606	542
Otros	73	9	613	1293	78	9	652	1630	97	9	304	845
Total	82	82	4907	4907	88	88	6472	6472	106	106	3690	3690

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.