

Fecha de Publicación: 3 de mayo de 2013

Fecha de Información: 30 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\$1076,7 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	299,2	227,3	49,5	144,2	106,8	84,0	71,0
15-35	216,4	280,1	134,0	74,0	116,1	112,4	30,0
36-60	68,8	28,2	0,0	2,3	28,2	66,6	0,0
61-90	5,2	4,0	0,0	0,0	4,0	5,2	0,0
91-180	1,7	15,1	0,0	0,0	15,1	1,7	0,0
>180	17,6	29,2	10,0	0,0	4,2	2,6	15,0
Total	608,9	583,8	193,5	220,5	274,3	272,5	116,0

* 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	1,7 %	3,0 %	2,4 %	2,5 %
15-35	2,9 %	2,6 %	2,9 %	2,7 %
36-60	-	2,8 %	2,8 %	2,8 %
61-90	-	3,6 %	3,0 %	3,2 %
91-180	-	3,5 %	2,6 %	3,4 %
>180	3,2 %	3,3 %	2,6 %	3,2 %
Total	2,2 %	2,8 %	2,7 %	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**	8	74	2986	2669	10	80	3389	3864	10	98	1826	2331
Intragrupa y off-shore***	0	0	1503	1129	0	0	2549	1137	0	0	1606	542
Otros	74	8	618	1309	80	10	752	1689	98	10	307	865
Total	81	81	5107	5107	91	91	6690	6690	107	107	3738	3738

* 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.