

Fecha de Publicación: 6 de mayo de 2013

Fecha de Información: 02 de mayo 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\$1559,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.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	276,1	161,3	46,7	40,3	34,6	155,7	80,0
15-35	414,6	537,7	412,0	76,0	44,8	257,6	81,0
36-60	87,8	0,7	0,0	0,0	0,7	87,8	0,0
61-90	3,7	6,6	0,0	0,0	6,6	3,7	0,0
91-180	64,8	110,3	31,6	0,0	18,7	4,8	60,0
>180	81,5	104,9	0,0	0,0	34,9	11,5	70,0
Total	928,4	921,6	490,3	116,3	140,3	521,1	291,0

* 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	-0,5 %	2,5 %	2,1 %	1,4 %
15-35	3,1 %	3,1 %	2,9 %	3,0 %
36-60	-	4,3 %	2,8 %	2,8 %
61-90	-	3,3 %	2,9 %	3,2 %
91-180	2,5 %	3,2 %	2,6 %	2,7 %
>180	2,9 %	3,1 %	2,9 %	3,0 %
Total	1,9 %	3,1 %	2,6 %	2,6 %

* 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	71	3003	2680	22	78	3534	3989	18	101	1921	2358
Intragrupa y off-shore***	0	0	1513	1143	0	1	2586	1161	0	0	1606	542
Otros	71	8	619	1312	78	21	790	1760	101	18	304	930
Total	79	79	5135	5135	101	101	6910	6910	119	119	3830	3830

* 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.