

Fecha de Publicación: 7 de mayo de 2013

Fecha de Información: 03 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\$1266,8 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	475,8	305,8	101,8	210,8	54,0	115,1	150,0
15-35	303,5	386,8	150,0	114,5	54,8	7,0	182,0
36-60	13,5	24,0	4,0	4,0	20,0	9,5	0,0
61-90	7,3	25,4	10,0	0,0	15,4	7,3	0,0
91-180	16,0	17,6	0,0	0,0	4,6	3,0	13,0
>180	25,1	25,9	0,0	10,0	10,9	0,1	15,0
Total	841,3	785,5	265,8	339,3	159,7	142,1	360,0

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

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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.

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	75	3003	2677	23	79	3857	4120	20	101	2070	2533
Intragrupoy off-shore***	0	0	1513	1143	0	1	2608	1347	0	0	1686	567
Otros	75	8	616	1312	79	22	794	1791	101	20	355	1010
Total	82	82	5132	5132	102	102	7259	7259	121	121	4110	4110

* 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.