

Fecha de Publicación: 8 de mayo de 2013

Fecha de Información: 06 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\$1113,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	234,2	189,2	87,2	22,2	57,0	167,0	45,0
15-35	484,4	295,7	137,3	58,0	14,4	282,4	144,0
36-60	4,5	18,4	0,0	0,0	18,4	4,5	0,0
61-90	0,3	2,4	0,0	0,0	2,4	0,3	0,0
91-180	0,2	29,5	0,0	0,0	29,5	0,2	0,0
>180	5,9	43,0	0,0	0,0	38,0	0,9	5,0
Total	729,4	578,2	224,5	80,2	159,7	455,2	194,0

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

*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	6 al 10 de mayo				13 al 17 de mayo				20 al 24 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	81	4019	4253	20	102	2095	2584	13	116	3476	2819
Intragrupa y off-shore***	0	1	2695	1369	0	0	1686	567	0	0	1700	1491
Otros	81	24	794	1886	102	20	406	1035	116	13	442	1308
Total	107	107	7508	7508	122	122	4187	4187	129	129	5618	5618

* 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.