

Fecha de Publicación: 13 de mayo de 2013

Fecha de Información: 09 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\$1835,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	405,7	364,0	183,7	161,8	114,4	177,9	66,0
15-35	415,5	596,7	485,8	112,7	14,0	205,8	97,0
36-60	7,8	16,4	0,0	0,0	16,4	7,8	0,0
61-90	0,9	4,9	0,0	0,0	4,9	0,9	0,0
91-180	17,0	20,2	0,0	10,0	20,2	7,0	0,0
>180	32,4	116,6	95,0	28,3	21,6	4,1	0,0
Total	879,3	1118,8	764,4	312,7	191,4	403,6	163,0

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

* 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

Sector	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	85	4463	4486	22	107	2529	3144	15	117	3948	3153
Intragrupa y off-shore***	0	1	2880	1725	0	0	1884	632	0	0	1920	1618
Otros	85	24	787	1919	107	22	623	1259	117	15	462	1558
Total	110	110	8130	8130	129	129	5035	5035	131	131	6330	6330

* 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.