

Fecha de Publicación: 16 de mayo de 2013

Fecha de Información: 14 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\$1398,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	368,7	346,1	235,0	258,5	87,1	86,2	24,0
15-35	246,2	347,3	316,4	66,0	19,9	169,2	11,0
36-60	20,3	3,1	0,0	0,0	3,1	20,3	0,0
61-90	3,0	9,8	0,0	0,0	9,8	3,0	0,0
91-180	11,6	9,8	0,0	0,0	9,8	11,6	0,0
>180	23,1	45,0	45,0	0,0	0,0	23,1	0,0
Total	672,9	761,0	596,4	324,5	129,6	313,4	35,0

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

*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	13 al 17 de mayo				20 al 24 de mayo				27 al 31 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	107	3010	3425	15	120	3999	3479	9	63	1617	1627
Intragrupa y off-shore***	0	0	1997	926	0	0	2113	1643	0	0	1013	535
Otros	107	23	705	1361	120	15	591	1580	63	9	341	809
Total	131	131	5712	5712	135	135	6703	6703	72	72	2972	2972

* 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.