

Fecha de Publicación: 18 de mayo de 2013

Fecha de Información: 16 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\$1600,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	81,3	413,0	233,0	10,0	130,1	21,3	50,0
15-35	518,2	701,9	515,5	48,0	7,9	291,7	178,5
36-60	10,6	3,7	0,0	3,0	3,7	7,6	0,0
61-90	9,3	24,6	0,0	0,0	24,6	9,3	0,0
91-180	2,3	13,6	5,0	0,0	8,6	2,3	0,0
>180	32,7	42,1	0,0	0,0	17,1	7,7	25,0
Total	654,4	1199,1	753,5	61,0	192,1	339,9	253,5

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

*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	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	103	3248	3457	15	121	4236	3937	9	70	1625	1898
Intragrupa y off-shore***	0	0	2005	1141	0	0	2320	1708	0	0	1278	535
Otros	103	23	704	1358	121	15	757	1668	70	9	344	814
Total	127	127	5957	5957	136	136	7313	7313	79	79	3247	3247

* 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.