

Fecha de Publicación: 22 de mayo de 2013

Fecha de Información: 20 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\$1308,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.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	360,3	412,8	126,5	13,5	26,8	87,3	259,5
15-35	342,5	462,1	294,0	110,0	9,1	73,5	159,0
36-60	5,5	36,1	30,0	0,0	6,1	5,5	0,0
61-90	3,3	3,3	0,0	0,0	3,3	3,3	0,0
91-180	61,9	47,2	0,0	0,0	32,2	46,9	15,0
>180	5,2	6,8	0,0	0,0	1,8	0,2	5,0
Total	778,6	968,3	450,5	123,5	79,3	216,6	438,5

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

*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	20 al 24 de mayo				27 al 31 de mayo				3 al 7 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	122	4621	4463	9	70	1750	1985	2	69	1992	2465
Intragrupa y off-shore***	0	0	2483	1782	0	0	1293	535	0	0	1597	537
Otros	122	16	828	1686	70	9	377	899	69	2	356	943
Total	137	137	7931	7931	79	79	3419	3419	71	71	3946	3946

* 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.