

Fecha de Publicación: 25 de mayo de 2013

Fecha de Información: 23 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\$1501,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	276,9	210,2	12,2	74,8	85,0	89,1	113,0
15-35	407,7	453,0	328,8	104,8	35,2	213,9	89,0
36-60	103,7	51,2	20,0	0,0	31,2	103,7	0,0
61-90	15,6	8,4	0,0	0,0	8,4	15,6	0,0
91-180	78,6	77,5	10,0	0,0	12,5	23,6	55,0
>180	55,6	40,5	10,0	0,0	10,5	35,6	20,0
Total	937,9	840,8	381,0	179,5	182,8	481,4	277,0

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

*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	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	118	5026	4744	10	76	1969	2352	3	68	2291	2670
Intragrupa y off-shore***	0	0	2610	2016	0	0	1349	545	0	0	1616	541
Otros	118	16	827	1703	76	10	556	976	68	3	460	1157
Total	134	134	8463	8463	86	86	3873	3873	71	71	4368	4368

* 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.