

Fecha de Publicación: 28 de mayo de 2013

Fecha de Información: 24 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\$1060,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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	232,2	184,5	64,0	103,0	75,4	84,1	45,1
15-35	254,7	369,8	220,2	70,0	67,5	102,7	82,0
36-60	18,9	1,4	0,0	0,0	1,4	18,9	0,0
61-90	6,3	6,8	0,0	0,1	6,8	6,3	0,0
91-180	20,1	4,8	0,0	1,6	4,8	18,5	0,0
>180	42,5	45,1	40,0	0,1	5,1	42,4	0,0
Total	574,7	612,3	324,2	174,8	161,0	272,8	127,1

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

* 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	114	5030	4744	11	81	2126	2436	3	68	2361	2766
Intragrupa y off-shore***	0	0	2610	2016	0	0	1393	628	0	0	1636	561
Otros	114	16	827	1707	81	11	566	1020	68	3	522	1192
Total	130	130	8467	8467	92	92	4084	4084	71	71	4520	4520

* 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.