

Fecha de Publicación: 29 de mayo de 2013

Fecha de Información: 27 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\$134,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.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	35,7	31,0	13,0	13,0	1,0	5,7	17,0
15-35	34,0	22,7	0,0	1,0	5,7	16,0	17,0
36-60	1,2	1,6	0,0	0,0	1,6	1,2	0,0
61-90	1,0	7,9	0,0	0,0	7,9	1,0	0,0
91-180	6,1	5,8	0,0	0,0	5,8	6,1	0,0
>180	18,6	11,1	0,0	0,0	2,9	10,4	8,2
Total	96,5	80,0	13,0	14,0	24,8	40,3	42,2

* 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	0,0 %	3,7 %	1,2 %	1,5 %
15-35	3,3 %	4,2 %	1,9 %	2,9 %
36-60	-	3,9 %	2,3 %	3,3 %
61-90	-	3,8 %	2,8 %	3,7 %
91-180	-	3,6 %	3,2 %	3,4 %
>180	3,5 %	3,9 %	3,0 %	3,3 %
Total	2,0 %	3,8 %	2,1 %	2,5 %

*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	27 al 31 de mayo				3 al 7 de junio				10 al 14 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	83	2139	2449	3	67	2382	2783	16	101	1850	2354
Intragrupa y off-shore***	0	0	1406	641	0	0	1636	561	0	0	1534	463
Otros	83	12	566	1021	67	3	522	1196	101	16	426	994
Total	94	94	4111	4111	71	71	4540	4540	117	117	3811	3811

* 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.