

Fecha de Publicación: 31 de mayo de 2013

Fecha de Información: 29 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\$1559,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	302,7	158,3	90,5	224,5	27,7	38,1	40,1
15-35	568,5	379,1	251,7	319,0	21,4	143,5	106,0
36-60	1,4	1,3	0,0	0,4	1,3	1,0	0,0
61-90	89,1	5,9	0,0	30,8	5,9	58,3	0,0
91-180	1,3	115,8	110,0	0,3	5,8	0,9	0,0
>180	9,2	72,6	70,0	0,0	2,6	9,2	0,0
Total	972,1	732,9	522,2	575,1	64,6	251,0	146,1

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

*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**	10	83	2612	2644	5	70	2740	3297	16	110	1928	2378
Intragrupa y off-shore***	0	0	1476	1008	0	0	2012	857	0	0	1539	476
Otros	83	10	609	1045	70	5	623	1221	110	16	430	1043
Total	93	93	4697	4697	74	74	5375	5375	126	126	3897	3897

* 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.