

Fecha de Publicación: 1 de junio de 2013

Fecha de Información: 30 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\$1129,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	212,3	251,5	138,3	52,4	53,2	99,9	60,0
15-35	170,8	249,5	204,0	120,8	22,5	27,0	23,0
36-60	54,5	53,2	0,0	0,2	53,2	54,3	0,0
61-90	49,3	6,6	0,0	0,4	6,6	48,9	0,0
91-180	12,6	51,0	43,6	0,0	7,5	12,6	0,0
>180	39,5	61,4	60,0	0,0	1,4	39,5	0,0
Total	539,0	673,1	445,9	173,8	144,3	282,2	83,0

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

*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	2670	2662	6	71	2799	3339	16	113	2023	2567
Intragrupa y off-shore***	0	0	1496	1061	0	1	2032	857	0	0	1637	476
Otros	83	10	607	1050	71	5	625	1259	113	16	481	1098
Total	93	93	4773	4773	76	76	5455	5455	129	129	4141	4141

* 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.