

Fecha de Publicación: 6 de junio de 2013

Fecha de Información: 04 de junio 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\$1095,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	200,0	169,4	21,5	45,0	14,9	22,0	133,0
15-35	353,0	324,1	151,8	113,5	89,8	156,9	82,6
36-60	38,4	67,8	5,0	0,0	62,8	38,4	0,0
61-90	1,9	22,7	0,0	0,0	22,7	1,9	0,0
91-180	5,4	94,8	77,0	1,7	17,8	3,7	0,0
>180	29,5	14,1	0,0	16,0	4,1	3,5	10,0
Total	628,2	692,9	255,3	176,2	212,1	226,4	225,6

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,8 %	4,0 %	3,0 %	3,0 %
15-35	3,4 %	3,2 %	3,2 %	3,2 %
36-60	-	3,6 %	3,1 %	3,5 %
61-90	-	3,2 %	3,0 %	3,2 %
91-180	-	3,3 %	3,1 %	3,3 %
>180	3,3 %	3,7 %	3,2 %	3,4 %
Total	3,0 %	3,4 %	3,1 %	3,2 %

*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	3 al 7 de junio				10 al 14 de junio				17 al 21 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	6	73	3001	3465	26	122	2055	2630	15	68	2742	2782
Intragruppo y off-shore***	0	1	2071	957	0	0	1643	476	0	0	1760	775
Otros	73	5	626	1277	122	26	520	1112	68	15	413	1358
Total	80	80	5698	5698	148	148	4217	4217	83	83	4915	4915

* 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 intragruppo.