

Fecha de Publicación: 7 de junio de 2013

Fecha de Información: 05 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\$1515,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	255,2	185,4	120,0	187,0	43,4	46,2	22,0
15-35	337,5	560,1	394,8	234,5	76,8	14,5	88,5
36-60	62,0	49,1	0,0	0,0	49,1	62,0	0,0
61-90	77,2	14,4	0,0	0,2	9,4	71,9	5,0
91-180	26,3	40,5	8,0	3,5	12,5	2,8	20,0
>180	7,0	36,4	30,0	3,0	6,4	4,0	0,0
Total	765,2	886,1	552,8	428,2	197,8	201,5	135,5

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

Sector	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	74	3200	3523	27	124	2085	2704	16	68	2774	2842
Intragrupa y off-shore***	0	1	2106	1144	0	0	1683	476	0	0	1805	775
Otros	74	5	638	1277	124	27	544	1132	68	16	420	1382
Total	80	80	5943	5943	151	151	4312	4312	84	84	4999	4999

* 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.