

Fecha de Publicación: 8 de junio de 2013

Fecha de Información: 06 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\$1579,6 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	318,3	248,6	147,2	128,7	47,4	135,6	54,0
15-35	241,3	671,8	564,0	122,8	45,8	56,6	62,0
36-60	3,3	4,3	0,0	0,0	4,3	3,3	0,0
61-90	12,4	41,5	0,0	0,2	41,5	12,2	0,0
91-180	24,1	108,3	70,0	0,0	38,3	24,1	0,0
>180	8,8	12,7	10,0	0,0	2,7	8,8	0,0
Total	608,3	1087,3	791,2	251,7	180,1	240,6	116,0

* 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	1,8 %	3,0 %	2,1 %	2,3 %
15-35	3,5 %	3,7 %	3,0 %	3,5 %
36-60	-	2,3 %	4,9 %	3,4 %
61-90	-	3,3 %	3,0 %	3,3 %
91-180	-	3,3 %	2,9 %	3,2 %
>180	-	3,3 %	2,8 %	3,1 %
Total	2,7 %	3,5 %	2,6 %	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	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**	7	71	3233	3596	27	127	2243	2758	16	68	2899	2962
Intragrupa y off-shore***	0	1	2148	1165	0	0	1700	560	0	0	1893	799
Otros	71	6	659	1279	127	27	559	1184	68	16	430	1461
Total	78	78	6039	6039	154	154	4503	4503	84	84	5222	5222

* 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.