

Fecha de Publicación: 12 de junio de 2013

Fecha de Información: 07 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\$1384,5 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	475,6	302,4	92,5	147,5	34,9	153,1	175,0
15-35	378,2	292,2	172,0	129,0	67,2	196,2	53,0
36-60	16,2	40,3	0,0	0,0	40,3	16,2	0,0
61-90	16,6	11,9	0,0	0,0	11,9	16,6	0,0
91-180	30,6	16,7	0,0	0,0	16,7	30,6	0,0
>180	2,0	29,7	5,0	0,0	24,7	2,0	0,0
Total	919,2	693,3	269,5	276,5	195,8	414,7	228,0

* 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	3,8 %	3,7 %	2,6 %	3,2 %
15-35	3,2 %	3,3 %	3,1 %	3,2 %
36-60	-	3,4 %	3,2 %	3,3 %
61-90	-	3,4 %	3,0 %	3,2 %
91-180	-	3,6 %	3,0 %	3,2 %
>180	-	3,4 %	3,0 %	3,3 %
Total	3,7 %	3,4 %	2,9 %	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**	7	74	3233	3597	28	127	2545	2928	16	72	3073	3090
Intragrupa y off-shore***	0	1	2148	1165	0	0	1772	673	0	0	1913	834
Otros	74	6	659	1279	127	28	581	1298	72	16	439	1500
Total	81	81	6040	6040	154	154	4898	4898	88	88	5424	5424

* 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.