

Fecha de Publicación: 13 de junio de 2013

Fecha de Información: 11 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\$1431,7 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	470,3	253,1	35,0	171,5	56,9	137,6	161,2
15-35	306,5	430,9	306,0	223,5	81,9	40,0	43,0
36-60	3,0	56,7	0,0	0,0	56,7	3,0	0,0
61-90	16,6	4,6	0,0	0,0	4,6	16,6	0,0
91-180	12,8	67,0	10,0	4,3	56,9	8,5	0,1
>180	7,4	7,1	3,3	4,3	3,8	3,1	0,0
Total	816,5	819,4	354,3	403,5	260,9	208,8	204,3

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

Sector	10 al 14 de junio				17 al 21 de junio				24 al 28 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	125	2822	3092	16	76	3173	3156	31	95	2382	2236
Intragrupa y off-shore***	0	0	1807	810	0	0	1913	868	0	0	1447	1162
Otros	125	29	584	1311	76	16	471	1532	95	31	465	897
Total	154	154	5213	5213	92	92	5556	5556	126	126	4295	4295

* 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.