

Fecha de Publicación: 14 de junio de 2013

Fecha de Información: 12 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\$2075,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupos y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	710,8	180,1	138,0	615,0	26,6	80,3	15,5
15-35	323,1	648,5	581,0	147,5	31,5	139,6	36,0
36-60	74,5	68,9	0,8	0,0	58,1	64,5	10,0
61-90	6,7	73,3	15,0	0,2	58,3	6,5	0,0
91-180	18,7	11,3	0,0	15,2	11,3	3,5	0,0
>180	13,2	8,1	0,0	0,0	8,1	13,2	0,0
Total	1147,1	990,1	734,8	777,9	193,9	307,7	61,5

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

* 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	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**	30	122	3250	3108	16	77	3288	3313	31	96	2585	2297
Intragrupos y off-shore***	0	0	1815	1216	0	0	2043	916	0	0	1495	1349
Otros	122	30	591	1333	77	16	486	1588	96	31	466	900
Total	151	151	5656	5656	93	93	5817	5817	126	126	4546	4546

* 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.