

Fecha de Publicación: 18 de junio de 2013

Fecha de Información: 14 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\$1482,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	466,5	245,5	66,4	177,7	23,1	132,8	156,0
15-35	376,9	399,5	205,8	182,0	56,3	57,4	137,5
36-60	1,0	36,8	0,8	0,0	36,0	1,0	0,0
61-90	11,0	39,3	0,8	0,0	28,5	1,0	10,0
91-180	28,0	135,7	96,3	10,0	29,4	8,0	10,0
>180	2,7	54,9	10,0	0,0	43,6	1,4	1,3
Total	885,9	911,7	380,0	369,7	216,9	201,5	314,8

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

*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	110	3273	3117	17	78	3976	3637	31	100	2837	2381
Intragrupa y off-shore***	0	0	1815	1229	0	0	2142	1225	0	0	1512	1413
Otros	110	30	590	1333	78	17	500	1756	100	31	480	1035
Total	140	140	5679	5679	95	95	6618	6618	131	131	4829	4829

* 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.