

Fecha de Publicación: 19 de junio de 2013

Fecha de Información: 17 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\$1288,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	421,8	137,1	46,0	240,8	23,1	113,0	68,0
15-35	340,8	307,7	279,8	141,0	7,0	178,8	21,0
36-60	54,3	73,2	10,0	0,0	63,2	54,3	0,0
61-90	2,6	9,7	0,0	0,0	9,7	2,6	0,0
91-180	0,9	15,9	0,0	0,0	15,9	0,9	0,0
>180	9,7	4,2	0,0	0,0	4,2	9,7	0,0
Total	830,1	547,8	335,8	381,8	123,1	359,3	89,0

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

*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	17 al 21 de junio								24 al 28 de junio				1 al 5 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	81	4328	3721	30	101	2907	2427	5	52	1522	2278				
Intragrupa y off-shore***	0	0	2142	1434	0	0	1558	1445	0	0	1544	663				
Otros	81	18	516	1831	101	30	480	1074	52	5	328	453				
Total	98	98	6986	6986	131	131	4945	4945	57	57	3394	3394				

* 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.