

Fecha de Publicación: 20 de junio de 2013

Fecha de Información: 18 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\$1466,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	272,4	264,4	44,0	40,0	115,4	127,4	105,0
15-35	338,7	634,6	443,5	85,0	7,3	69,9	183,8
36-60	80,4	44,4	30,0	0,0	14,4	80,4	0,0
61-90	4,7	5,1	0,0	0,0	5,1	4,7	0,0
91-180	5,5	38,0	35,6	0,0	2,4	5,5	0,0
>180	62,9	28,9	0,0	15,0	3,9	22,9	25,0
Total	764,6	1015,4	553,1	140,0	148,4	310,8	313,8

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,4 %	3,2 %	2,7 %	3,0 %
15-35	3,6 %	5,6 %	3,3 %	4,5 %
36-60	-	3,6 %	3,2 %	3,3 %
61-90	-	3,6 %	3,1 %	3,4 %
91-180	-	3,6 %	3,2 %	3,5 %
>180	3,5 %	4,6 %	3,2 %	3,4 %
Total	3,5 %	4,7 %	3,0 %	3,8 %

*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	17 al 21 de junio				24 al 28 de junio				1 al 5 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	82	4387	3786	31	99	3040	2631	5	52	1688	2388
Intragruppo y off-shore***	0	0	2186	1473	0	0	1558	1445	0	0	1606	663
Otros	82	18	521	1835	99	31	595	1117	52	5	328	571
Total	100	100	7094	7094	130	130	5193	5193	57	57	3622	3622

* 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 intragruppo.