

Fecha de Publicación: 21 de junio de 2013

Fecha de Información: 19 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\$1482,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	538,9	315,3	75,8	80,2	9,5	228,8	230,0
15-35	302,1	377,8	253,4	41,3	7,5	143,9	117,0
36-60	66,5	67,2	0,0	0,0	52,2	51,5	15,0
61-90	29,7	13,8	0,0	0,0	13,8	29,7	0,0
91-180	21,6	26,7	0,0	0,0	6,7	1,6	20,0
>180	53,9	55,9	0,0	0,0	50,9	48,9	5,0
Total	1012,8	856,7	329,2	121,4	140,5	504,4	387,0

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

*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

Sectores	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	79	4484	3896	31	110	3385	2768	5	52	1790	2451
Intragrupa y off-shore***	0	0	2254	1525	0	0	1565	1474	0	0	1607	663
Otros	79	18	523	1840	110	31	597	1305	52	5	329	612
Total	97	97	7261	7261	140	140	5546	5546	57	57	3726	3726

* 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.