

Fecha de Publicación: 22 de junio de 2013

Fecha de Información: 20 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\$1949,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,3%.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	280,2	92,1	10,0	36,8	32,1	193,5	50,0
15-35	409,0	1085,7	813,5	3,0	43,2	177,0	229,0
36-60	71,3	34,5	0,0	0,0	34,5	71,3	0,0
61-90	51,4	22,8	20,0	0,0	2,8	51,4	0,0
91-180	40,9	6,2	0,0	0,0	6,2	40,9	0,0
>180	131,0	20,3	0,0	30,0	3,3	84,0	17,0
Total	983,9	1261,7	843,5	69,8	122,2	618,1	296,0

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

*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**	20	84	4588	3912	33	110	3530	2829	5	52	1825	2474
Intragrupa y off-shore***	0	0	2254	1543	0	0	1575	1492	0	0	1615	663
Otros	84	20	518	1906	110	33	634	1417	52	5	329	632
Total	103	103	7360	7360	144	144	5738	5738	57	57	3769	3769

* 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.