

Fecha de Publicación: 26 de junio de 2013

Fecha de Información: 24 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\$840,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.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	204,2	113,0	73,0	24,0	20,0	160,2	20,0
15-35	350,5	54,5	8,5	197,0	22,0	129,5	24,0
36-60	62,7	8,8	0,0	0,0	8,8	62,7	0,0
61-90	8,3	9,8	0,0	0,0	9,8	8,3	0,0
91-180	6,1	29,3	10,0	0,0	19,3	6,1	0,0
>180	9,9	27,8	25,0	0,0	2,8	9,9	0,0
Total	641,6	243,3	116,5	221,0	82,8	376,6	44,0

* 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 %	13,6 %	3,2 %	6,5 %
15-35	3,6 %	4,4 %	3,4 %	3,5 %
36-60	-	3,8 %	3,4 %	3,4 %
61-90	-	4,0 %	3,2 %	3,6 %
91-180	-	4,1 %	3,5 %	4,0 %
>180	-	3,7 %	3,5 %	3,7 %
Total	3,4 %	8,5 %	3,3 %	4,6 %

*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	24 al 28 de junio				1 al 5 de julio				8 al 12 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	124	4144	3137	5	40	1908	2608	99	54	1824	2349
Intragruppo y off-shore***	0	0	1777	1706	0	0	1726	674	0	0	1620	553
Otros	124	35	675	1753	40	5	327	678	54	99	342	884
Total	159	159	6596	6596	45	45	3960	3960	153	153	3786	3786

* 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.