

Fecha de Publicación: 28 de junio de 2013

Fecha de Información: 26 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\$1647,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	453,9	370,6	162,5	60,0	38,1	223,9	170,0
15-35	515,4	268,8	98,3	214,5	27,0	157,4	143,5
36-60	8,7	11,8	0,0	0,0	11,8	8,7	0,0
61-90	56,7	112,0	110,0	0,0	2,0	56,7	0,0
91-180	0,4	40,2	28,2	0,0	12,0	0,4	0,0
>180	0,8	122,2	0,0	0,0	122,2	0,8	0,0
Total	1035,9	925,5	399,0	274,5	213,0	447,9	313,5

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

*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	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**	34	124	4456	3402	8	41	2123	2671	100	55	2343	2484
Intragrupa y off-shore***	0	0	1928	1853	0	0	1735	717	0	0	1650	638
Otros	124	34	701	1830	41	8	346	816	55	100	347	1217
Total	158	158	7084	7084	49	49	4204	4204	156	156	4340	4340

* 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.