

Fecha de Publicación: 01 de julio de 2013

Fecha de Información: 27 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\$1066,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	286,1	270,4	79,0	62,0	22,3	55,0	169,1
15-35	335,7	344,1	190,0	170,3	32,1	43,4	122,0
36-60	67,8	8,1	0,0	0,0	8,1	67,8	0,0
61-90	2,8	19,3	10,0	0,0	9,3	2,8	0,0
91-180	10,2	17,9	0,0	0,0	7,9	0,2	10,0
>180	0,6	4,8	0,1	0,0	4,7	0,6	0,0
Total	703,3	664,6	279,1	232,3	84,4	169,9	301,1

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

*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	120	4592	3504	9	44	2247	2794	100	55	2366	2524
Intragrupa y off-shore***	0	0	1986	1908	0	0	1742	724	0	0	1664	638
Otros	120	34	700	1867	44	9	358	829	55	100	354	1220
Total	154	154	7278	7278	52	52	4347	4347	156	156	4383	4383

* 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.