

Fecha de Publicación: 3 de julio de 2013

Fecha de Información: 28 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\$1532,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	413,4	283,9	172,0	120,6	41,9	222,8	70,0
15-35	308,9	588,8	447,5	109,0	76,3	134,9	65,0
36-60	3,3	13,9	0,0	0,0	13,9	3,3	0,0
61-90	5,1	6,8	0,0	0,0	6,8	5,1	0,0
91-180	14,1	18,9	0,0	1,1	8,9	3,0	10,0
>180	11,9	18,6	0,0	0,0	8,6	1,9	10,0
Total	756,7	930,9	619,5	230,6	156,4	371,0	155,0

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

*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	116	4594	3502	10	44	2506	3009	101	56	2517	2590
Intragrupa y off-shore***	0	0	1986	1908	0	1	1862	842	0	0	1716	639
Otros	116	34	698	1869	44	9	383	899	56	101	367	1371
Total	151	151	7279	7279	54	54	4750	4750	157	157	4600	4600

* 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.