

Fecha de Publicación: 4 de julio de 2013

Fecha de Información: 02 de julio 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\$1556,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	529,1	192,1	71,0	247,0	11,1	172,1	110,0
15-35	172,6	631,0	546,0	81,2	22,0	28,4	63,0
36-60	17,9	35,7	0,0	0,0	35,7	17,9	0,0
61-90	40,8	53,3	0,0	35,8	50,3	2,0	3,0
91-180	15,2	38,5	18,0	0,0	5,5	0,2	15,0
>180	0,3	21,1	20,0	0,0	1,1	0,3	0,0
Total	776,0	971,7	655,0	364,0	125,7	220,9	191,0

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

*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

Sectores	1 al 5 de julio				8 al 12 de julio				15 al 19 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	44	2786	3056	102	56	2672	2733	107	137	2299	2594
Intragrupa y off-shore***	0	1	1864	1064	0	0	1785	664	0	0	1627	891
Otros	44	9	388	917	56	102	371	1430	137	107	454	895
Total	54	54	5037	5037	158	158	4828	4828	245	245	4381	4381

* 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.