

Fecha de Publicación: 8 de julio de 2013

Fecha de Información: 04 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\$130,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.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	41,8	47,6	0,0	0,0	7,6	1,8	40,0
15-35	23,9	36,7	5,0	13,5	21,7	0,4	10,0
36-60	2,4	5,0	0,0	0,0	5,0	2,4	0,0
61-90	11,2	3,7	0,0	0,0	3,7	11,2	0,0
91-180	0,6	6,0	0,1	0,0	5,9	0,6	0,0
>180	0,1	1,8	0,1	0,0	1,7	0,1	0,0
Total	79,9	100,9	5,2	13,5	45,7	16,4	50,0

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

*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	48	2892	3121	102	66	2759	2770	108	146	2307	2644
Intragrupa y off-shore***	0	1	1916	1091	0	0	1785	664	0	0	1667	891
Otros	48	9	391	987	66	102	368	1478	146	108	457	896
Total	58	58	5199	5199	168	168	4912	4912	254	254	4431	4431

* 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.