

Fecha de Publicación: 9 de julio de 2013

Fecha de Información: 05 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\$1269,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	305,1	240,5	77,0	70,0	43,5	115,1	120,0
15-35	421,7	426,6	155,0	47,0	55,6	158,7	216,0
36-60	55,9	69,3	0,0	0,0	34,3	20,9	35,0
61-90	51,9	24,9	5,0	20,0	4,9	16,9	15,0
91-180	37,6	17,6	0,0	15,0	2,6	7,6	15,0
>180	16,6	8,1	0,2	0,0	2,9	11,6	5,0
Total	888,8	787,0	237,2	152,0	143,8	330,8	406,0

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

* 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

Sector	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	47	2892	3118	111	67	2946	2880	101	146	2422	2774
Intragrupa y off-shore***	0	1	1916	1091	0	0	1847	734	0	0	1682	891
Otros	47	9	388	987	67	111	376	1555	146	101	492	932
Total	57	57	5196	5196	179	179	5169	5169	247	247	4597	4597

* 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.