

Fecha de Publicación: 10 de julio de 2013

Fecha de Información: 08 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\$722,5 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	226,3	111,4	74,0	55,0	4,4	138,3	33,0
15-35	232,5	129,2	53,5	39,0	6,7	124,5	69,0
36-60	62,2	2,5	0,0	0,0	2,5	62,2	0,0
61-90	13,4	4,0	0,0	0,0	4,0	13,4	0,0
91-180	6,5	6,7	0,0	0,0	6,7	6,5	0,0
>180	14,3	15,3	10,0	0,0	5,3	14,3	0,0
Total	555,3	269,2	137,5	94,0	29,7	359,3	102,0

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

Sectores	8 al 12 de julio				15 al 19 de julio				22 al 26 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	114	65	3041	2982	105	146	2505	2774	10	98	1835	2372
Intragrupa y off-shore***	0	0	1913	779	0	0	1682	891	0	0	1506	724
Otros	65	114	378	1571	146	105	493	1015	98	10	392	638
Total	179	179	5332	5332	252	252	4680	4680	108	108	3733	3733

* 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.