

Fecha de Publicación: 11 de julio de 2013

Fecha de Información: 09 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\$1746,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	393,9	321,9	208,5	172,0	4,3	112,8	109,1
15-35	425,9	504,8	352,0	269,0	43,3	47,4	109,5
36-60	92,9	31,2	0,0	0,0	31,2	92,9	0,0
61-90	115,7	32,1	0,6	85,0	16,5	15,7	15,0
91-180	0,5	5,7	0,0	0,0	5,7	0,5	0,0
>180	20,5	40,3	30,0	10,0	5,3	5,5	5,0
Total	1049,4	936,0	591,1	536,0	106,3	274,8	238,6

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,0 %	3,3 %	3,6 %	3,3 %
15-35	3,7 %	4,5 %	4,1 %	4,2 %
36-60	-	4,5 %	4,2 %	4,2 %
61-90	4,0 %	4,1 %	4,2 %	4,2 %
91-180	-	3,5 %	3,9 %	3,5 %
>180	3,7 %	3,9 %	3,9 %	3,9 %
Total	3,4 %	4,1 %	3,9 %	3,9 %

*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	69	3206	3121	111	144	2657	2932	10	99	1916	2431
Intragruppo y off-shore***	0	0	1984	865	0	0	1797	907	0	0	1549	794
Otros	69	114	379	1584	144	111	493	1108	99	10	398	639
Total	183	183	5569	5569	256	256	4947	4947	109	109	3863	3863

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.