

Fecha de Publicación: 12 de julio de 2013

Fecha de Información: 10 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\$1564,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.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	625,3	233,4	77,5	322,3	1,9	149,1	154,0
15-35	251,6	612,2	412,8	79,0	56,5	29,6	143,0
36-60	0,5	9,4	0,0	0,0	9,4	0,5	0,0
61-90	23,5	25,0	0,0	0,0	5,0	3,5	20,0
91-180	10,8	2,7	1,0	4,5	1,8	6,3	0,0
>180	22,9	83,6	40,0	0,0	23,6	2,9	20,0
Total	934,7	966,4	531,2	405,8	98,2	191,9	337,0

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

*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	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	68	3558	3222	111	147	2813	2970	10	97	2076	2569
Intragrupa y off-shore***	0	0	1998	1125	0	0	1810	907	0	0	1620	877
Otros	68	114	397	1606	147	111	493	1239	97	10	399	649
Total	182	182	5953	5953	258	258	5116	5116	107	107	4095	4095

* 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 intragrupo.