

Fecha de Publicación: 17 de julio de 2013

Fecha de Información: 15 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\$1180,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	177,8	216,1	62,3	40,0	43,8	27,8	110,0
15-35	514,9	218,7	95,0	265,8	92,7	218,1	31,0
36-60	32,6	21,9	1,0	5,0	20,9	27,6	0,0
61-90	1,2	20,1	1,1	0,0	19,0	1,2	0,0
91-180	45,6	45,0	0,4	0,0	44,6	45,6	0,0
>180	2,5	25,4	0,0	2,4	25,4	0,0	0,0
Total	774,7	547,2	159,8	313,2	246,4	320,5	141,0

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

*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	15 al 19 de julio				22 al 26 de julio				29 de jul. al 2 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	100	140	3243	3249	16	104	2586	2935	5	57	1453	2054
Intragrupa y off-shore***	0	0	1942	1128	0	0	1778	970	0	0	1290	440
Otros	140	100	525	1333	104	16	442	900	57	5	309	558
Total	240	240	5711	5711	120	120	4805	4805	61	61	3052	3052

* 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.