

Fecha de Publicación: 23 de julio de 2013

Fecha de Información: 19 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\$1082,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.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	360,8	198,7	57,5	142,5	6,2	83,3	135,0
15-35	242,3	442,0	280,0	73,0	79,5	86,8	82,5
36-60	22,7	2,2	0,0	0,0	2,2	22,7	0,0
61-90	7,0	9,4	0,0	0,0	9,4	7,0	0,0
91-180	0,1	14,0	0,0	0,0	14,0	0,1	0,0
>180	0,4	0,8	0,0	0,0	0,8	0,4	0,0
Total	633,2	667,1	337,5	215,5	112,1	200,2	217,5

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

*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	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**	102	139	3692	3389	19	116	3217	3316	5	63	1907	2446
Intragrupa y off-shore***	0	0	2022	1500	0	0	1963	1202	0	0	1352	548
Otros	139	102	535	1361	116	19	464	1126	63	5	312	576
Total	240	240	6250	6250	135	135	5644	5644	69	69	3570	3570

* 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.