

Fecha de Publicación: 29 de julio de 2013

Fecha de Información: 25 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\$1079,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.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	209,1	195,2	165,0	119,5	10,2	69,6	20,0
15-35	273,4	247,1	168,0	161,5	21,1	53,9	58,0
36-60	16,7	72,8	0,0	3,3	64,8	5,4	8,0
61-90	30,1	4,0	0,0	0,0	4,0	30,1	0,0
91-180	4,9	33,5	5,0	0,0	28,5	4,9	0,0
>180	15,2	63,2	50,0	10,0	13,2	5,2	0,0
Total	549,3	615,8	388,0	294,3	141,8	169,0	86,0

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

*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	22 al 26 de julio				29 de jul. al 2 de agosto				5 al 9 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	114	3350	3532	8	69	2610	2944	11	73	2282	2731
Intragrupa y off-shore***	0	0	2146	1260	0	0	1620	697	0	0	1467	642
Otros	114	20	455	1159	69	8	356	945	73	11	466	842
Total	134	134	5951	5951	77	77	4585	4585	84	84	4215	4215

* 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.