

Fecha de Publicación: 30 de julio de 2013

Fecha de Información: 26 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\$886,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	186,2	199,3	117,2	68,8	2,1	37,4	80,0
15-35	293,9	154,0	126,1	89,0	5,9	182,9	22,0
36-60	36,5	0,8	0,0	12,0	0,8	24,5	0,0
61-90	4,8	21,6	20,0	0,0	1,6	4,8	0,0
91-180	35,9	43,3	30,0	0,0	13,3	35,9	0,0
>180	0,4	11,3	0,0	0,0	11,3	0,4	0,0
Total	557,7	430,3	293,3	169,8	35,0	285,9	102,0

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

*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	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	107	3346	3532	9	66	2769	3129	11	74	2309	2747
Intragrupa y off-shore***	0	0	2146	1260	0	0	1721	740	0	0	1483	668
Otros	107	20	456	1155	66	9	359	981	74	11	466	843
Total	126	126	5948	5948	75	75	4849	4849	85	85	4258	4258

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.