

Fecha de Publicación: 31 de julio de 2013

Fecha de Información: 29 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\$663,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.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	251,6	117,9	77,0	158,0	6,8	59,5	34,1
15-35	68,3	139,0	96,0	33,0	27,0	19,3	16,0
36-60	86,5	22,7	20,0	0,0	2,7	86,5	0,0
61-90	0,0	1,1	0,0	0,0	1,1	0,0	0,0
91-180	2,5	16,7	0,0	0,0	16,7	2,5	0,0
>180	0,9	6,2	0,0	0,0	6,2	0,9	0,0
Total	409,8	303,6	193,0	191,0	60,5	168,7	50,1

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

*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	29 de jul. al 2 de agosto				5 al 9 de agosto				12 al 16 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	66	2928	3187	11	75	2369	2784	7	152	2587	2190
Intragrupa y off-shore***	0	0	1762	873	0	0	1519	678	0	0	1236	989
Otros	66	10	367	997	75	11	467	893	152	7	509	1151
Total	76	76	5057	5057	86	86	4355	4355	159	159	4331	4331

* 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.