

Fecha de Publicación: 1 de agosto de 2013

Fecha de Información: 30 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\$1020,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.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	234,5	116,8	69,0	158,9	7,8	35,6	40,0
15-35	381,3	339,9	227,5	196,5	27,4	99,8	85,0
36-60	12,2	3,7	0,0	0,0	3,7	12,2	0,0
61-90	4,0	11,3	0,0	0,0	11,3	4,0	0,0
91-180	0,3	14,3	0,0	0,0	14,3	0,3	0,0
>180	26,5	11,1	0,0	0,0	1,1	16,5	10,0
Total	658,7	497,1	296,5	355,4	65,6	168,3	135,0

* 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	4,1 %	3,7 %	1,9 %	2,6 %
15-35	-14,5 %	3,5 %	3,5 %	0,9 %
36-60	-	4,7 %	4,1 %	4,3 %
61-90	-	4,3 %	0,4 %	3,3 %
91-180	-	4,1 %	3,5 %	4,1 %
>180	3,9 %	4,5 %	3,9 %	3,9 %
Total	-7,6 %	3,6 %	2,9 %	1,7 %

*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

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**	16	62	3064	3282	12	76	2376	2792	7	158	2843	2264
Intragrupa y off-shore***	0	1	1821	958	0	0	1529	681	0	0	1267	1158
Otros	62	15	382	1027	76	12	465	897	158	7	510	1197
Total	78	78	5267	5267	87	87	4370	4370	164	164	4620	4620

* 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.