

Fecha de Publicación: 2 de agosto de 2013

Fecha de Información: 31 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\$1561,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	658,7	225,3	123,0	407,0	5,3	154,7	97,0
15-35	245,2	539,1	385,3	96,5	66,8	61,7	87,0
36-60	14,0	5,8	0,0	0,0	5,8	14,0	0,0
61-90	13,5	5,5	0,0	0,0	5,5	13,5	0,0
91-180	6,1	12,4	0,0	4,5	12,4	1,6	0,0
>180	12,4	19,5	0,0	0,0	7,5	0,4	12,0
Total	950,0	807,6	508,3	508,0	103,3	246,0	196,0

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

*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

Sector	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	63	3466	3372	12	76	2574	2870	7	158	2912	2328
Intragruppo y off-shore***	0	1	1894	1330	0	0	1579	706	0	0	1274	1168
Otros	63	15	382	1040	76	12	468	1045	158	7	512	1201
Total	79	79	5742	5742	87	87	4621	4621	164	164	4697	4697

* 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.