

Fecha de Publicación: 25 de junio de 2013

Fecha de Información: 21 de junio de 2013¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1582,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	509,6	333,8	240,0	201,0	24,8	239,6	69,0
15-35	273,2	403,7	251,0	116,0	76,7	81,2	76,0
36-60	12,2	3,3	0,0	0,0	3,3	12,2	0,0
61-90	7,1	22,4	20,0	0,0	2,4	7,1	0,0
91-180	20,5	28,7	25,0	0,0	3,7	20,5	0,0
>180	84,5	28,3	20,0	55,3	8,3	29,1	0,0
Total	907,0	820,2	556,0	372,3	119,2	389,7	145,0

* 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	
3-14	3,7 %	3,5 %	2,7 %	3,0 %
15-35	3,7 %	3,4 %	3,4 %	3,4 %
36-60	-	4,0 %	3,1 %	3,3 %
61-90	-	3,9 %	3,2 %	3,8 %
91-180	-	4,0 %	3,3 %	3,4 %
>180	-	3,9 %	3,4 %	3,6 %
Total	3,7 %	3,5 %	2,9 %	3,2 %

*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	17 al 21 de junio				24 al 28 de junio				1 al 5 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	85	4588	3901	34	122	3993	3022	5	37	1869	2613
Intragrupo y off-shore***	0	0	2254	1543	0	0	1704	1682	0	0	1726	674
Otros	85	20	508	1906	122	34	654	1646	37	5	332	640
Total	105	105	7349	7349	156	156	6351	6351	42	42	3927	3927

* 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.