

Fecha de Publicación: 15 de julio de 2013

Fecha de Información: 11 de julio 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\$1275,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	304,1	281,3	212,0	108,5	9,3	135,6	60,0
15-35	255,6	348,6	285,0	40,5	49,6	201,1	14,0
36-60	16,3	8,6	0,0	0,0	8,6	16,3	0,0
61-90	46,1	36,6	2,1	0,5	14,5	25,6	20,0
91-180	8,4	25,9	0,0	0,0	25,9	8,4	0,0
>180	12,0	26,2	1,0	0,0	25,2	12,0	0,0
Total	642,6	727,3	500,2	149,5	133,1	399,1	94,0

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	2,0 %	4,2 %	2,7 %	3,3 %
15-35	4,5 %	4,5 %	4,3 %	4,4 %
36-60	-	4,3 %	4,1 %	4,2 %
61-90	2,8 %	3,9 %	4,0 %	3,6 %
91-180	-	3,6 %	3,6 %	3,6 %
>180	-	3,8 %	-0,9 %	2,3 %
Total	2,5 %	4,3 %	3,4 %	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	8 al 12 de julio				15 al 19 de julio				22 al 26 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	114	62	3636	3316	111	146	2942	3132	16	96	2177	2612
Intragruo y off-shore***	0	0	2092	1194	0	0	1909	927	0	0	1659	897
Otros	62	114	397	1615	146	111	496	1289	96	16	403	730
Total	175	175	6125	6125	258	258	5348	5348	112	112	4239	4239

* 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 intragruo.