

Fecha de Publicación: 18 de julio de 2013

Fecha de Información: 16 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\$1681,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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	307,5	231,2	125,5	171,8	14,7	44,8	91,0
15-35	594,8	415,1	194,5	299,6	55,6	130,3	165,0
36-60	55,7	59,7	0,0	0,0	12,7	8,7	47,0
61-90	113,2	39,3	0,4	90,0	28,9	13,2	10,0
91-180	30,0	72,7	2,2	0,0	70,5	30,0	0,0
>180	39,9	65,5	0,0	0,0	35,5	9,9	30,0
Total	1141,2	883,5	322,7	561,3	217,8	236,9	343,0

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

*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	15 al 19 de julio				22 al 26 de julio				29 de jul. al 2 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	100	146	3438	3323	16	109	2643	3026	5	58	1575	2165
Intragrupa y off-shore***	0	0	1988	1288	0	0	1848	975	0	0	1300	458
Otros	146	100	523	1339	109	16	447	937	58	5	311	562
Total	247	247	5949	5949	126	126	4938	4938	62	62	3185	3185

* 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.