

Fecha de Publicación: 19 de julio de 2013

Fecha de Información: 17 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\$1420,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.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	473,7	158,4	111,0	325,5	12,4	113,2	35,0
15-35	324,0	431,8	322,8	128,0	74,0	161,0	35,0
36-60	16,6	31,6	0,0	0,0	15,6	0,6	16,0
61-90	2,1	35,2	0,0	0,0	35,2	2,1	0,0
91-180	1,5	16,7	2,2	0,0	14,1	1,1	0,4
>180	11,2	9,6	0,0	0,0	4,6	6,2	5,0
Total	829,0	683,2	436,0	453,5	155,8	284,1	91,4

* 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	3,7 %	2,8 %	3,5 %	3,4 %
15-35	3,9 %	4,1 %	2,8 %	3,5 %
36-60	4,0 %	4,6 %	3,2 %	4,3 %
61-90	-	4,1 %	3,6 %	4,1 %
91-180	3,9 %	4,1 %	2,0 %	4,0 %
>180	0,0 %	3,0 %	3,7 %	2,3 %
Total	3,6 %	3,8 %	3,1 %	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**	102	133	3669	3393	18	110	2859	3100	5	62	1623	2191
Intragruo y off-shore***	0	0	2022	1487	0	0	1903	1085	0	0	1322	494
Otros	133	102	539	1351	110	18	452	1028	62	5	314	574
Total	235	235	6231	6231	128	128	5214	5214	67	67	3259	3259

* 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.