

Fecha de Publicación: 6 de agosto de 2013

Fecha de Información: 02 de agosto 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\$1530,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	388,3	327,6	229,0	189,0	8,6	109,3	90,0
15-35	513,5	513,9	153,0	78,0	130,9	205,5	230,0
36-60	3,7	9,2	0,0	0,0	9,2	3,7	0,0
61-90	24,0	26,4	0,8	0,0	10,6	9,0	15,0
91-180	15,6	51,3	1,8	0,0	39,6	5,6	10,0
>180	0,7	1,6	0,0	0,0	1,6	0,7	0,0
Total	945,8	930,0	384,5	267,0	200,5	333,8	345,0

* 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	3,3 %	3,9 %	3,5 %	3,5 %
15-35	3,7 %	4,3 %	4,1 %	4,0 %
36-60	-	4,5 %	3,4 %	4,2 %
61-90	4,0 %	4,3 %	4,0 %	4,1 %
91-180	3,9 %	3,4 %	3,9 %	3,6 %
>180	-	4,2 %	3,6 %	4,0 %
Total	3,6 %	4,1 %	3,8 %	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	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	62	3513	3383	16	68	2911	3126	17	165	3042	2751
Intragrupo y off-shore***	0	1	1899	1370	0	0	1706	885	0	0	1684	1186
Otros	62	15	388	1047	68	16	477	1084	165	17	521	1309
Total	78	78	5800	5800	84	84	5094	5094	182	182	5246	5246

* 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.