

Fecha de Publicación: 14 de agosto de 2013

Fecha de Información: 12 de agosto 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\$1341,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	523,0	313,8	50,0	81,0	10,0	188,2	253,8
15-35	348,7	310,4	105,0	135,0	70,9	79,2	134,5
36-60	7,2	5,4	0,0	0,0	5,4	7,2	0,0
61-90	10,2	4,0	0,0	0,0	4,0	10,2	0,0
91-180	15,8	122,4	5,8	0,0	101,6	0,8	15,0
>180	57,1	83,3	10,6	0,0	15,7	0,1	57,0
Total	962,0	839,3	171,5	216,0	207,6	285,8	460,3

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

*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	12 al 16 de agosto				19 al 23 de agosto				26 al 30 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	189	3835	3308	10	95	2455	2772	23	89	1855	2152
Intragruppo y off-shore***	6	0	2129	1723	0	0	1821	643	0	0	1404	725
Otros	183	19	552	1485	95	10	296	1157	89	23	369	751
Total	208	208	6516	6516	105	105	4572	4572	112	112	3628	3628

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.