

Fecha de Publicación: 5 de agosto de 2013

Fecha de Información: 01 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\$1539,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	139,5	354,0	313,0	48,5	7,5	57,5	33,5
15-35	489,0	582,2	332,6	167,9	18,6	90,1	231,0
36-60	68,7	2,4	0,0	0,0	2,4	68,7	0,0
61-90	21,9	12,3	0,0	10,0	2,3	1,9	10,0
91-180	36,8	103,8	65,0	0,0	3,8	1,8	35,0
>180	35,6	12,3	1,5	0,0	0,8	25,6	10,0
Total	791,5	1067,0	712,1	226,4	35,4	245,6	319,5

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

*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	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	66	3511	3383	16	75	2611	2999	16	156	2958	2549
Intragrupa y off-shore***	0	1	1899	1370	0	0	1677	706	0	0	1484	1176
Otros	66	15	388	1045	75	16	469	1052	156	16	519	1235
Total	82	82	5798	5798	91	91	4757	4757	172	172	4960	4960

* 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.