

Fecha de Publicación: 7 de agosto de 2013

Fecha de Información: 05 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\$761,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.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	225,7	182,2	97,5	47,5	4,6	98,1	80,1
15-35	98,1	246,3	100,5	26,0	76,8	3,1	69,0
36-60	70,4	18,6	0,0	0,0	18,6	70,4	0,0
61-90	3,6	8,6	0,0	0,0	8,6	3,6	0,0
91-180	21,5	13,6	0,0	0,0	13,6	21,5	0,0
>180	20,0	21,9	0,0	0,0	1,9	0,0	20,0
Total	439,3	491,1	198,0	73,5	124,0	196,7	169,1

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,5 %	4,4 %	4,1 %	4,5 %
15-35	4,3 %	4,5 %	3,9 %	4,4 %
36-60	-	4,3 %	3,7 %	3,9 %
61-90	-	4,1 %	3,8 %	4,0 %
91-180	-	4,2 %	3,7 %	3,9 %
>180	0,0 %	5,1 %	3,6 %	0,4 %
Total	4,4 %	4,4 %	3,9 %	4,2 %

*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

Sector	5 al 9 de agosto				12 al 16 de agosto				19 al 23 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	67	2984	3178	17	169	3200	2877	9	86	1811	2208
Intragruppo y off-shore***	0	0	1719	905	0	0	1769	1213	0	0	1461	463
Otros	67	17	476	1096	169	17	522	1400	86	9	292	893
Total	84	84	5179	5179	187	187	5491	5491	95	95	3564	3564

* 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 intragruppo.