

Fecha de Publicación: 10 de agosto de 2013

Fecha de Información: 08 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\$1938,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.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	445,1	317,1	260,8	292,9	16,3	112,3	40,0
15-35	542,2	674,0	450,5	131,0	76,5	264,2	147,0
36-60	31,1	11,0	0,0	30,0	11,0	1,1	0,0
61-90	10,0	11,2	0,0	0,0	11,2	10,0	0,0
91-180	23,7	60,7	20,0	0,0	17,4	0,4	23,3
>180	0,0	22,7	17,0	0,0	5,7	0,0	0,0
Total	1052,2	1096,7	748,3	453,9	138,1	388,0	210,3

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

*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	69	3367	3303	18	183	3553	3132	9	93	2072	2599		
Intragrupa y off-shore***	0	0	1719	1162	6	0	1979	1518	0	0	1798	560		
Otros	69	17	476	1096	178	18	539	1421	93	9	291	1002		
Total	86	86	5561	5561	202	202	6071	6071	102	102	4161	4161		

* 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.