

Fecha de Publicación: 21 de agosto de 2013

Fecha de Información: 16 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\$990,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	110,0	141,5	108,8	59,0	2,7	21,0	30,0
15-35	328,3	476,6	364,8	118,5	0,8	98,8	111,0
36-60	15,2	0,3	0,0	0,0	0,3	15,2	0,0
61-90	2,7	23,2	22,5	0,0	0,7	2,7	0,0
91-180	19,2	4,7	0,0	10,0	4,7	9,2	0,0
>180	8,6	1,5	0,0	4,7	1,5	3,9	0,0
Total	484,0	647,8	496,0	192,2	10,8	150,8	141,0

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

*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**	22	178	4146	3572	14	105	3071	3102	29	96	2395	2377
Intragrupa y off-shore***	6	0	2342	1971	0	0	1954	938	0	0	1560	869
Otros	173	22	556	1501	105	14	303	1289	96	29	393	1101
Total	200	200	7044	7044	119	119	5329	5329	126	126	4348	4348

* 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.