

Fecha de Publicación: 22 de agosto de 2013

Fecha de Información: 20 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\$1492,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.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	204,8	142,8	97,0	119,0	20,8	60,8	25,0
15-35	722,3	414,8	232,0	112,9	30,3	456,9	152,5
36-60	29,1	43,6	15,0	0,0	17,3	17,8	11,3
61-90	14,6	34,9	0,0	0,0	34,9	14,6	0,0
91-180	35,8	10,1	0,0	0,0	10,1	35,8	0,0
>180	18,1	10,7	0,0	6,4	10,7	11,7	0,0
Total	1024,7	656,8	344,0	238,3	124,0	597,6	188,8

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

*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	19 al 23 de agosto				26 al 30 de agosto				2 al 6 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	107	3165	3153	30	95	2480	2464	10	73	2143	2594
Intragrupa y off-shore***	0	0	1981	991	0	0	1630	915	0	0	1247	575
Otros	107	17	303	1304	95	30	411	1140	73	10	534	754
Total	124	124	5449	5449	125	125	4520	4520	83	83	3923	3923

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