

Fecha de Publicación: 23 de agosto de 2013

Fecha de Información: 21 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\$1694,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.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	447,9	117,7	46,0	263,5	27,7	140,4	44,0
15-35	423,1	600,8	498,5	113,0	3,3	211,1	99,0
36-60	10,8	35,5	0,0	0,0	35,5	10,8	0,0
61-90	14,6	3,9	0,0	0,0	3,9	14,6	0,0
91-180	73,5	29,8	10,0	5,0	10,8	59,5	9,0
>180	61,7	30,7	25,0	20,0	1,7	37,7	4,0
Total	1031,6	818,4	579,5	401,5	82,9	474,1	156,0

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

*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**	16	114	3447	3209	30	102	2527	2505	10	72	2324	2594
Intragrupa y off-shore***	0	0	2017	1229	0	0	1640	915	0	0	1247	601
Otros	114	16	294	1320	102	30	426	1173	72	10	534	910
Total	131	131	5758	5758	132	132	4593	4593	83	83	4105	4105

* 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.