

Fecha de Publicación: 24 de agosto de 2013

Fecha de Información: 22 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\$1460,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.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	283,4	174,1	59,0	34,0	9,1	143,4	106,0
15-35	484,3	575,4	480,3	35,0	23,2	377,3	72,0
36-60	13,6	7,6	0,0	0,0	7,6	13,6	0,0
61-90	37,3	36,7	0,0	0,0	6,7	7,3	30,0
91-180	17,5	25,4	0,0	0,0	10,4	2,5	15,0
>180	10,0	17,9	10,0	1,5	7,9	8,5	0,0
Total	846,0	837,1	549,3	70,5	64,9	552,5	223,0

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

*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

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	117	3480	3247	30	102	2753	2629	11	73	2347	2604
Intragrupa y off-shore***	0	0	2056	1244	0	0	1660	934	0	0	1247	601
Otros	117	17	292	1339	102	30	435	1284	73	11	534	922
Total	134	134	5829	5829	132	132	4848	4848	83	83	4128	4128

* 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.