

Fecha de Publicación: 27 de agosto de 2013

Fecha de Información: 23 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\$1033,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.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	272,4	253,2	178,3	142,8	13,9	68,6	61,0
15-35	245,1	322,0	154,3	142,5	76,7	11,6	91,0
36-60	12,0	3,8	0,0	0,0	3,8	12,0	0,0
61-90	6,1	11,3	4,5	0,0	6,8	6,1	0,0
91-180	1,2	9,6	0,0	0,0	9,6	1,2	0,0
>180	22,0	46,6	19,0	1,5	7,6	0,5	20,0
Total	558,9	646,4	356,0	286,8	118,4	100,1	172,0

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

*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	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	115	3481	3247	31	105	2948	2820	11	74	2423	2664
Intragrupa y off-shore***	0	0	2056	1244	0	0	1838	1066	0	0	1247	612
Otros	115	17	293	1339	105	31	445	1345	74	11	536	928
Total	132	132	5830	5830	135	135	5231	5231	85	85	4205	4205

* 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.