

Fecha de Publicación: 10 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 06 de septiembre 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\$1658,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	554,6	380,2	160,5	187,5	15,7	163,1	204,0
15-35	274,9	439,7	244,0	51,0	64,7	92,9	131,0
36-60	108,9	53,9	50,0	101,5	3,9	7,4	0,0
61-90	46,9	19,7	0,0	0,0	6,7	33,9	13,0
91-180	33,4	24,2	0,0	0,0	21,2	30,4	3,0
>180	21,7	70,8	10,0	0,0	40,8	1,7	20,0
Total	1040,5	988,5	464,5	340,0	153,0	329,5	371,0

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

*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	2 al 6 de septiembre				9 al 13 de septiembre				16 al 20 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	3	73	3841	3659	25	64	4067	3651	51	66	2911	2811
Intragrupa y off-shore***	0	1	1684	1353	0	0	1554	968	0	0	1625	804
Otros	73	2	637	1148	64	25	613	1615	66	51	442	1364
Total	76	76	6161	6161	88	88	6234	6234	117	117	4979	4979

* 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.