

Fecha de Publicación: 11 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 09 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\$1764,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	438,7	180,4	142,7	273,5	7,7	135,2	30,0
15-35	468,0	329,2	179,2	309,0	87,0	96,0	63,0
36-60	102,4	139,6	110,0	0,0	8,5	81,3	21,2
61-90	27,7	42,2	0,0	0,0	42,2	27,7	0,0
91-180	75,3	126,1	42,0	0,0	9,1	0,3	75,0
>180	1,1	22,9	20,0	0,0	2,9	1,1	0,0
Total	1113,3	840,5	493,9	582,5	157,5	341,7	189,2

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

*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	9 al 13 de septiembre				16 al 20 de septiembre				23 al 27 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	70	4307	3764	51	70	3084	2871	25	77	2376	2680
Intragrupa y off-shore***	0	0	1657	1201	0	0	1665	845	0	0	1641	781
Otros	70	25	614	1612	70	51	442	1476	77	25	555	1111
Total	95	95	6578	6578	121	121	5192	5192	102	102	4572	4572

* 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.