

Fecha de Publicación: 12 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 10 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\$1201,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	141,5	278,8	236,8	65,6	11,1	45,1	30,9
15-35	364,7	365,1	250,0	87,0	24,1	186,7	91,0
36-60	86,7	18,5	0,7	0,0	17,8	86,7	0,0
61-90	2,0	7,0	0,0	1,8	7,0	0,2	0,0
91-180	19,2	19,0	0,0	1,0	16,8	16,0	2,2
>180	10,4	12,2	10,0	10,0	2,2	0,4	0,0
Total	624,6	700,5	497,5	165,3	78,9	335,2	124,1

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

*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	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	4363	3958	51	75	3131	2926	34	80	2507	2735
Intragrupa y off-shore***	0	0	1852	1233	0	0	1707	877	0	0	1669	783
Otros	70	25	613	1636	75	51	445	1480	80	34	562	1220
Total	94	94	6827	6827	126	126	5283	5283	114	114	4738	4738

* 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.