

Fecha de Publicación: 13 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 11 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\$1128,0 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	356,1	147,4	30,0	209,3	11,4	40,8	106,0
15-35	332,8	248,7	187,5	150,0	28,7	150,3	32,5
36-60	5,5	16,2	0,0	0,0	16,2	5,5	0,0
61-90	1,0	14,5	0,0	0,0	14,5	1,0	0,0
91-180	43,6	63,7	40,0	0,0	23,7	43,6	0,0
>180	24,0	33,8	0,0	1,0	12,9	2,2	20,9
Total	763,1	524,3	257,5	360,3	107,4	243,5	159,4

* 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	2,3 %	3,4 %	2,5 %	2,6 %
15-35	2,7 %	3,2 %	3,0 %	3,0 %
36-60	-	3,7 %	3,0 %	3,5 %
61-90	-	3,4 %	3,8 %	3,4 %
91-180	-	3,4 %	3,1 %	3,2 %
>180	0,1 %	3,4 %	3,2 %	1,6 %
Total	2,1 %	3,3 %	2,8 %	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	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	71	4562	4011	53	82	3254	2988	34	83	2603	2766
Intragrupa y off-shore***	0	0	1872	1384	4	0	1703	934	0	0	1687	838
Otros	71	25	613	1651	78	53	449	1484	83	34	565	1251
Total	96	96	7046	7046	135	135	5405	5405	117	117	4855	4855

* 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.