

Fecha de Publicación: 14 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 12 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\$1376,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	369,5	188,7	54,5	247,7	47,3	34,8	87,0
15-35	470,1	369,0	263,4	120,5	21,6	265,7	84,0
36-60	19,9	14,3	0,0	0,0	14,3	19,9	0,0
61-90	20,5	8,5	0,0	0,0	8,5	20,5	0,0
91-180	1,2	38,3	25,0	0,0	13,3	1,2	0,0
>180	23,0	47,7	10,0	0,0	14,7	0,0	23,0
Total	904,3	666,4	352,9	368,2	119,5	342,2	194,0

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

*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	4663	4060	53	86	3499	3071	34	83	2628	2821
Intragrupa y off-shore***	0	0	1898	1446	4	0	1703	1100	0	0	1715	857
Otros	71	25	613	1668	81	53	466	1498	83	34	592	1257
Total	96	96	7174	7174	139	139	5669	5669	118	118	4934	4934

* 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.