

Fecha de Publicación: 17 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 13 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\$984,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.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	184,7	152,2	33,5	32,0	29,7	63,7	89,0
15-35	448,9	335,0	62,8	169,8	85,2	92,1	187,0
36-60	65,3	9,4	0,0	0,0	9,4	65,3	0,0
61-90	26,4	26,1	0,7	0,0	5,4	6,4	20,0
91-180	0,1	23,0	0,0	0,0	23,0	0,1	0,0
>180	5,0	9,1	0,0	0,0	4,1	0,0	5,0
Total	730,3	554,8	96,9	201,8	156,9	227,6	301,0

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

*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	68	4663	4060	85	87	3605	3151	34	83	2674	2891
Intragrupa y off-shore***	0	0	1898	1446	4	0	1716	1132	0	0	1735	857
Otros	68	25	613	1668	83	85	485	1524	83	34	601	1262
Total	93	93	7175	7175	172	172	5807	5807	118	118	5010	5010

* 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.