

Fecha de Publicación: 18 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 16 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\$876,7 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	269,8	172,3	15,0	45,5	5,3	72,3	152,0
15-35	319,6	82,8	61,0	166,0	14,8	146,6	7,0
36-60	31,2	95,5	0,0	0,0	95,5	31,2	0,0
61-90	7,8	17,0	0,7	0,0	13,9	5,3	2,5
91-180	1,1	11,4	0,0	1,1	11,4	0,0	0,0
>180	20,8	28,9	0,0	0,0	8,9	0,8	20,0
Total	650,3	407,9	76,7	212,6	149,8	256,2	181,5

* 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 %	3,2 %	2,6 %	2,8 %
15-35	2,9 %	2,9 %	2,7 %	2,7 %
36-60	-	3,2 %	2,8 %	3,1 %
61-90	3,0 %	2,5 %	2,7 %	2,6 %
91-180	-	3,1 %	2,4 %	3,0 %
>180	0,0 %	2,7 %	2,9 %	0,9 %
Total	2,6 %	3,0 %	2,7 %	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

Sector	16 al 20 de septiembre				23 al 27 de septiembre				30 de sep. al 4 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	85	85	3806	3281	35	84	2741	2931	9	48	1604	2230
Intragrupa y off-shore***	4	0	1716	1178	0	0	1750	857	0	0	1245	433
Otros	81	85	487	1551	84	35	603	1305	48	9	434	620
Total	170	170	6010	6010	119	119	5093	5093	57	57	3283	3283

* 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.