

Fecha de Publicación: 20 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 18 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\$1666,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	479,9	206,5	34,5	348,0	93,0	52,9	79,0
15-35	500,5	463,1	333,0	176,5	18,5	212,4	111,6
36-60	62,5	50,5	0,0	0,0	18,7	30,7	31,8
61-90	0,2	16,0	0,0	0,0	16,0	0,2	0,0
91-180	30,0	69,9	15,0	10,0	34,9	0,0	20,0
>180	10,0	29,9	10,0	0,0	9,9	0,0	10,0
Total	1083,1	835,9	392,5	534,5	191,1	296,3	252,3

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

*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	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**	86	91	4350	3495	32	86	3111	3161	9	47	1681	2337
Intragrupa y off-shore***	4	0	1741	1536	0	0	1865	1052	0	0	1282	493
Otros	87	86	523	1584	86	32	606	1370	47	9	498	630
Total	177	177	6614	6614	119	119	5582	5582	56	56	3460	3460

* 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.