

Fecha de Publicación: 21 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 19 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\$2171,5 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 | 519,8 | 217,7 | 26,9 | 148,5 | 65,8 | 246,3 | 125,0 |
| 15-35 | 614,7 | 520,2 | 324,5 | 268,8 | 77,7 | 228,0 | 118,0 |
| 36-60 | 155,8 | 113,6 | 0,1 | 6,3 | 73,4 | 109,5 | 40,0 |
| 61-90 | 25,1 | 71,0 | 0,1 | 0,0 | 60,9 | 15,1 | 10,0 |
| 91-180 | 39,3 | 140,7 | 11,7 | 0,0 | 89,7 | 0,0 | 39,3 |
| >180 | 20,0 | 85,8 | 25,0 | 0,0 | 40,8 | 0,0 | 20,0 |
| Total | 1374,8 | 1149,0 | 388,4 | 423,5 | 408,3 | 598,9 | 352,3 |

* 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 | 1,9 % | 6,8 % | 2,6 % | 3,1 % |
| 15-35 | 2,9 % | 3,0 % | 2,5 % | 2,8 % |
| 36-60 | 2,7 % | 3,0 % | 2,6 % | 2,7 % |
| 61-90 | 0,0 % | 3,2 % | 2,7 % | 2,8 % |
| 91-180 | 3,0 % | 3,2 % | - | 3,2 % |
| >180 | 0,0 % | 3,2 % | 2,8 % | 2,5 % |
| Total | 2,3 % | 3,5 % | 2,5 % | 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 | 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** | 95 | 92 | 4458 | 3547 | 23 | 87 | 3292 | 3213 | 10 | 88 | 1914 | 2411 |
| Intragrupa y off-shore*** | 4 | 0 | 1741 | 1591 | 0 | 0 | 1874 | 1127 | 0 | 0 | 1299 | 510 |
| Otros | 87 | 95 | 525 | 1587 | 87 | 23 | 614 | 1440 | 88 | 10 | 514 | 806 |
| Total | 187 | 187 | 6725 | 6725 | 110 | 110 | 5780 | 5780 | 97 | 97 | 3727 | 3727 |

* 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.