

Fecha de Publicación: 24 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 20 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\$1276,7 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	328,1	172,7	26,0	153,0	36,7	65,1	110,0
15-35	325,7	411,9	363,8	132,5	5,1	150,2	43,0
36-60	25,7	15,5	0,0	0,0	14,8	25,0	0,7
61-90	45,6	14,9	0,0	0,0	9,9	40,6	5,0
91-180	19,8	23,6	0,0	0,0	10,6	6,8	13,0
>180	38,7	64,3	20,0	0,0	6,3	0,7	38,0
Total	783,5	702,9	409,8	285,5	83,4	288,3	209,7

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

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**	95	91	4458	3558	24	81	3524	3326	10	89	2012	2462		
Intragrupa y off-shore***	4	0	1741	1591	0	0	1884	1220	0	0	1315	570		
Otros	87	95	537	1586	81	24	627	1489	89	10	529	824		
Total	187	187	6736	6736	106	106	6035	6035	99	99	3855	3855		

* 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.