

Fecha de Publicación: 26 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 24 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\$1495,5 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	280,7	185,9	72,0	178,5	62,9	51,2	51,0
15-35	496,8	422,3	251,5	190,5	38,8	174,3	132,0
36-60	9,1	39,9	25,0	0,0	14,9	9,1	0,0
61-90	20,1	24,6	0,0	0,0	24,6	20,1	0,0
91-180	33,7	108,7	67,6	0,0	21,0	13,5	20,2
>180	47,5	58,5	20,0	15,0	9,5	3,5	29,0
Total	887,8	839,9	436,1	384,0	171,6	271,6	232,2

* 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	2,4 %	3,3 %	3,6 %	3,3 %
15-35	2,9 %	2,7 %	2,5 %	2,7 %
36-60	-	3,0 %	2,7 %	3,0 %
61-90	-	3,3 %	2,7 %	3,0 %
91-180	1,6 %	3,1 %	2,8 %	2,8 %
>180	0,4 %	3,2 %	3,1 %	2,1 %
Total	2,3 %	3,0 %	2,9 %	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	23 al 27 de septiembre				30 de sep. al 4 de octubre				7 al 11 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	81	4225	3491	15	90	2058	2542	10	73	2711	2958
Intragrupa y off-shore***	0	0	1897	1566	0	0	1376	578	0	0	1707	965
Otros	81	16	643	1708	90	15	548	862	73	10	535	1031
Total	97	97	6765	6765	105	105	3982	3982	84	84	4953	4953

* 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.