

Fecha de Publicación: 27 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 25 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\$1526,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,5%.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	478,4	130,7	16,5	261,9	15,3	117,5	99,0
15-35	321,4	517,7	332,6	112,2	50,1	74,2	135,0
36-60	17,3	71,2	0,0	0,0	56,2	2,3	15,0
61-90	82,5	48,1	0,6	40,0	7,5	2,5	40,0
91-180	24,3	36,6	0,0	0,0	36,6	24,3	0,0
>180	57,7	85,1	21,8	1,5	7,3	0,2	56,0
Total	981,7	889,5	371,5	415,6	173,0	221,0	345,0

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

*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**	14	87	4416	3591	17	91	2253	2566	11	74	2822	2978
Intragrupa y off-shore***	0	0	1908	1632	0	0	1380	731	0	0	1707	1006
Otros	87	14	643	1743	91	17	557	893	74	11	535	1081
Total	102	102	6967	6967	107	107	4190	4190	86	86	5064	5064

* 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.