

Fecha de Publicación: 10 de octubre de 2013

Fecha de Información: 08 de octubre 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\$1282,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.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	199,7	249,8	192,5	27,0	17,3	132,7	40,0
15-35	305,0	393,9	230,5	138,0	80,4	84,0	83,0
36-60	88,2	24,1	0,0	0,0	10,1	74,2	14,0
61-90	7,0	11,8	0,0	0,0	11,8	7,0	0,0
91-180	55,0	41,3	0,0	0,0	17,3	31,0	24,0
>180	59,6	36,7	0,0	30,0	7,7	0,6	29,0
Total	714,4	757,7	423,0	195,0	144,7	329,4	190,0

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

*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	7 al 11 de octubre				14 al 18 de octubre				21 al 25 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	50	86	4267	4449	44	123	2607	2111	68	85	2518	2477
Intragrupa y off-shore***	0	0	2274	1232	0	0	982	814	0	0	1513	980
Otros	86	50	658	1518	123	44	365	1029	85	68	323	897
Total	136	136	7199	7199	167	167	3954	3954	153	153	4354	4354

* 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.