

Fecha de Publicación: 16 de octubre de 2013

Fecha de Información: 11 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\$1131,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	347,1	247,3	39,0	2,0	35,3	172,1	173,0
15-35	235,8	347,5	198,3	30,0	24,7	81,2	124,6
36-60	20,2	34,2	0,0	0,0	14,2	0,2	20,0
61-90	10,0	34,3	20,0	0,0	14,3	10,0	0,0
91-180	0,3	143,7	0,0	0,0	143,7	0,3	0,0
>180	17,9	25,6	0,0	0,0	10,6	2,9	15,0
Total	631,3	832,4	257,3	32,0	242,6	266,7	332,6

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

*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	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**	49	78	4609	4541	47	145	3030	2319	69	91	2724	2719
Intragrupa y off-shore***	0	0	2345	1290	25	0	1102	816	0	0	1530	986
Otros	78	49	657	1780	120	47	388	1384	91	69	349	899
Total	127	127	7611	7611	192	192	4520	4520	160	160	4604	4604

* 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.