

Fecha de Publicación: 19 de octubre de 2013

Fecha de Información: 17 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\$807,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.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	241,2	154,2	87,0	39,0	2,2	137,2	65,0
15-35	232,3	139,4	54,0	54,0	15,6	108,5	69,8
36-60	1,3	5,6	0,0	0,0	4,6	0,3	1,0
61-90	33,4	42,7	0,5	0,0	10,1	1,3	32,1
91-180	45,4	66,6	20,0	0,0	16,6	15,4	30,0
>180	22,7	25,6	0,0	0,0	20,6	17,7	5,0
Total	576,2	434,0	161,5	93,0	69,7	280,4	202,9

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

*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	14 al 18 de octubre				21 al 25 de octubre				28 de oct. al 1 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	47	121	3365	2523	71	99	3176	2958	14	98	2577	2656
Intragrupa y off-shore***	0	0	1250	973	0	0	1714	1130	0	0	1023	864
Otros	120	47	383	1503	99	71	354	1157	98	14	737	819
Total	168	168	4999	4999	169	169	5244	5244	112	112	4338	4338

* 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.