

Fecha de Publicación: 23 de octubre de 2013

Fecha de Información: 21 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\$1175,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	362,7	185,4	53,0	1,7	2,4	231,0	130,0
15-35	263,0	207,2	94,0	101,6	23,2	71,4	90,0
36-60	129,4	105,8	15,0	26,0	0,8	13,4	90,0
61-90	12,7	5,8	0,0	0,0	5,8	12,7	0,0
91-180	137,2	124,8	0,0	0,0	14,8	27,2	110,0
>180	14,5	61,0	40,0	0,0	7,0	0,5	14,0
Total	919,7	689,9	202,0	129,3	53,9	356,3	434,0

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

* 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	21 al 25 de octubre				28 de oct. al 1 de noviembre				4 al 8 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	72	102	3521	3335	14	107	2852	2811	5	66	2005	2312
Intragrupa y off-shore***	0	0	1949	1240	0	0	1082	865	0	0	1148	700
Otros	102	72	348	1242	107	14	744	1002	66	5	426	566
Total	174	174	5817	5817	121	121	4678	4678	71	71	3578	3578

* 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.