

Fecha de Publicación: 1 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 30 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\$1541,8 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	575,7	185,2	34,9	171,2	0,3	254,5	150,0
15-35	438,2	431,0	161,6	115,7	37,1	90,3	232,3
36-60	25,4	46,3	3,6	0,0	22,7	5,4	20,0
61-90	4,0	1,4	0,0	0,0	1,4	4,0	0,0
91-180	150,0	75,7	0,0	60,0	55,7	70,0	20,0
>180	0,1	31,1	30,0	0,0	1,1	0,1	0,0
Total	1193,4	770,7	230,1	346,8	118,3	424,3	422,3

* 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	2,4 %	3,7 %	2,8 %	2,7 %
15-35	1,2 %	3,3 %	3,1 %	2,4 %
36-60	14,0 %	3,4 %	2,9 %	7,8 %
61-90	-	3,6 %	2,9 %	3,1 %
91-180	2,9 %	3,3 %	3,1 %	3,1 %
>180	-	3,2 %	2,9 %	3,2 %
Total	2,3 %	3,3 %	2,9 %	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

Sector	28 de oct. al 1 de noviembre				4 al 8 de noviembre				11 al 15 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	103	5185	3846	7	71	2988	3044	9	116	1890	1922
Intragrupa y off-shore***	0	0	1557	1312	0	1	1443	841	0	0	899	650
Otros	103	25	698	2282	71	6	516	1062	116	9	442	660
Total	128	128	7439	7439	78	78	4947	4947	125	125	3232	3232

* 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.