

Fecha de Publicación: 2 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 31 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\$2635,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragruppo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|---------------|----------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 685,6 | 271,1 | 165,0 | 83,8 | 14,1 | 509,8 | 92,0 |
| 15-35 | 772,9 | 997,2 | 458,0 | 140,0 | 122,2 | 215,9 | 417,0 |
| 36-60 | 42,9 | 43,3 | 0,0 | 0,0 | 3,3 | 2,9 | 40,0 |
| 61-90 | 40,1 | 13,7 | 0,0 | 25,0 | 2,2 | 3,6 | 11,5 |
| 91-180 | 127,4 | 23,7 | 0,0 | 70,0 | 13,7 | 47,4 | 10,0 |
| >180 | 144,5 | 187,3 | 0,0 | 0,0 | 43,3 | 0,5 | 144,0 |
| Total | 1813,3 | 1536,2 | 623,0 | 318,8 | 198,7 | 780,0 | 714,5 |

* 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 intragruppo | | Total |
|--------------|--------------------|-------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 2,7 % | 2,7 % | 2,9 % | 2,8 % |
| 15-35 | 2,5 % | 3,6 % | 2,9 % | 3,0 % |
| 36-60 | 1,6 % | 4,0 % | 2,9 % | 1,9 % |
| 61-90 | 0,4 % | 3,7 % | 3,2 % | 2,5 % |
| 91-180 | 0,0 % | 4,7 % | 3,1 % | 3,0 % |
| >180 | 3,0 % | 0,4 % | 2,9 % | 2,4 % |
| Total | 2,5 % | 3,2 % | 2,9 % | 2,9 % |

*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 | 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 | 106 | 5281 | 3933 | 8 | 71 | 3464 | 3166 | 10 | 116 | 2005 | 1978 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1655 | 1331 | 0 | 1 | 1510 | 861 | 0 | 0 | 911 | 694 |
| Otros | 106 | 25 | 681 | 2353 | 71 | 6 | 524 | 1471 | 116 | 10 | 446 | 690 |
| Total | 131 | 131 | 7617 | 7617 | 78 | 78 | 5498 | 5498 | 126 | 126 | 3362 | 3362 |

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.