

Fecha de Publicación: 2 de octubre de 2013

Fecha de Información: 30 de septiembre 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\$1311,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.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	564,1	406,2	138,3	76,3	5,9	225,9	262,0
15-35	242,0	270,4	81,8	130,9	129,9	52,4	58,7
36-60	48,6	50,3	0,0	0,0	35,3	33,6	15,0
61-90	10,0	10,9	0,0	0,0	10,9	10,0	0,0
91-180	11,0	9,9	0,0	0,0	9,9	11,0	0,0
>180	19,5	22,7	4,2	0,0	0,0	1,0	18,5
Total	895,2	770,3	224,2	207,2	192,0	333,8	354,2

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

*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	30 de sep. al 4 de octubre				7 al 11 de octubre				14 al 18 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	85	3229	3074	14	75	3333	3628	37	107	2252	1790
Intragrupa y off-shore***	0	0	1502	835	0	1	1936	1033	0	0	834	706
Otros	85	19	565	1387	75	12	574	1183	107	37	297	886
Total	104	104	5296	5296	88	88	5843	5843	144	144	3383	3383

* 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.