

Fecha de Publicación: 3 de octubre de 2013

Fecha de Información: 01 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\$1456,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.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	354,2	267,1	157,5	123,1	29,6	151,1	80,0
15-35	516,0	297,8	103,7	316,3	22,0	27,7	172,0
36-60	65,2	50,5	41,3	0,0	9,3	65,2	0,0
61-90	10,1	69,4	31,6	0,0	27,8	0,1	10,0
91-180	1,1	20,8	0,0	0,0	20,8	1,1	0,0
>180	30,0	66,7	20,4	0,0	16,3	0,0	30,0
Total	976,5	772,3	354,5	439,4	125,8	245,2	292,0

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

*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	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**	18	83	3410	3147	24	76	3452	3786	44	107	2324	1840
Intragrupa y off-shore***	0	0	1525	905	0	1	2056	1065	0	0	849	749
Otros	83	18	576	1458	76	23	592	1250	107	44	302	886
Total	101	101	5510	5510	99	99	6100	6100	151	151	3475	3475

* 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.