

Fecha de Publicación: 4 de octubre de 2013

Fecha de Información: 02 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\$1390,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.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	400,5	300,3	47,0	163,0	69,3	53,5	184,0
15-35	456,3	439,7	173,2	213,1	83,5	60,2	183,0
36-60	0,5	20,4	0,0	0,0	20,4	0,5	0,0
61-90	0,0	34,9	0,0	0,0	34,9	0,0	0,0
91-180	11,1	72,1	1,1	0,0	60,9	1,1	10,0
>180	0,2	31,1	0,0	0,0	31,1	0,2	0,0
Total	868,6	898,4	221,3	376,0	300,1	115,6	377,0

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

*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**	18	84	3618	3168	24	82	3642	3983	44	109	2412	1955
Intragrupa y off-shore***	0	0	1530	1055	0	1	2068	1076	0	0	879	794
Otros	84	18	582	1506	82	23	603	1254	109	44	348	889
Total	101	101	5729	5729	105	105	6313	6313	153	153	3638	3638

* 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.