

Fecha de Publicación: 9 de octubre de 2013

Fecha de Información: 07 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\$918,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.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	159,2	303,8	171,0	15,5	67,8	78,7	65,0
15-35	230,4	272,9	150,0	126,0	26,9	8,4	96,0
36-60	34,8	42,1	0,0	0,0	27,1	19,8	15,0
61-90	17,1	7,6	0,0	0,0	7,6	17,1	0,0
91-180	10,7	9,4	0,0	0,0	9,4	10,7	0,0
>180	0,0	5,8	0,0	0,0	5,8	0,0	0,0
Total	452,4	641,6	321,0	141,5	144,6	134,9	176,0

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

*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	7 al 11 de octubre				14 al 18 de octubre				21 al 25 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	48	88	4121	4338	44	123	2562	2102	68	85	2500	2338
Intragrupa y off-shore***	0	0	2219	1210	0	0	976	814	0	0	1377	965
Otros	88	48	642	1434	123	44	361	984	85	68	320	894
Total	136	136	6982	6982	167	167	3900	3900	154	154	4197	4197

* 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.