

Fecha de Publicación: 15 de octubre de 2013

Fecha de Información: 10 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\$1451,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.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	401,4	187,8	101,0	51,0	14,8	278,4	72,0
15-35	372,6	341,6	195,3	114,8	37,4	148,8	109,0
36-60	80,7	12,9	0,0	0,0	12,9	80,7	0,0
61-90	28,9	28,0	0,0	0,0	13,0	13,9	15,0
91-180	23,2	49,5	0,5	0,0	48,9	23,2	0,0
>180	100,0	70,7	0,0	50,0	20,7	0,0	50,0
Total	1006,7	690,6	296,8	215,8	147,8	545,0	246,0

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

*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**	49	81	4609	4540	47	124	2826	2265	69	88	2580	2551
Intragrupa y off-shore***	0	0	2345	1290	0	0	1095	814	0	0	1523	986
Otros	81	49	656	1780	123	47	370	1213	88	69	332	898
Total	130	130	7610	7610	171	171	4292	4292	157	157	4435	4435

* 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.