

Fecha de Publicación: 31 de octubre de 2013

Fecha de Información: 29 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\$1663,8 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	464,4	201,8	16,1	72,1	19,7	226,4	166,0
15-35	535,2	696,7	259,5	54,0	83,2	127,2	354,0
36-60	102,0	26,8	0,0	0,0	6,8	82,0	20,0
61-90	7,7	2,6	0,0	0,0	2,6	7,7	0,0
91-180	88,9	37,2	0,0	0,0	10,2	61,9	27,0
>180	24,0	63,4	20,0	0,0	23,4	4,0	20,0
Total	1222,3	1028,5	295,6	126,1	145,9	509,2	587,0

* 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	4,0 %	3,8 %	3,2 %	3,5 %
15-35	0,9 %	3,2 %	3,0 %	2,2 %
36-60	0,8 %	3,4 %	2,9 %	2,6 %
61-90	-	3,5 %	3,0 %	3,1 %
91-180	3,2 %	3,4 %	3,1 %	3,2 %
>180	0,0 %	3,2 %	3,0 %	2,2 %
Total	1,8 %	3,3 %	3,1 %	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	28 de oct. al 1 de noviembre				4 al 8 de noviembre				11 al 15 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	106	4774	3774	5	71	2850	2998	9	114	1757	1804
Intragrupa y off-shore***	0	0	1537	1150	0	0	1428	832	0	0	899	617
Otros	106	15	766	2153	71	5	515	962	114	9	414	650
Total	121	121	7077	7077	76	76	4793	4793	123	123	3071	3071

* 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.