

Fecha de Publicación: 11 de octubre de 2013

Fecha de Información: 09 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\$1367,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.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	217,0	137,1	93,0	7,0	4,1	170,0	40,0
15-35	362,3	472,7	190,1	62,0	3,6	21,3	279,0
36-60	28,8	91,1	0,0	0,0	66,1	3,8	25,0
61-90	56,0	84,8	40,0	20,0	14,8	6,0	30,0
91-180	111,7	90,7	0,0	2,2	3,6	22,4	87,2
>180	131,9	170,6	42,0	0,0	2,6	5,9	126,0
Total	907,8	1047,1	365,1	91,2	94,9	229,4	587,2

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

*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	80	4428	4503	45	122	2633	2154	69	84	2548	2517	
Intragrupa y off-shore***	0	0	2318	1239	0	0	1022	814	0	0	1522	980	
Otros	80	49	658	1662	122	45	367	1055	84	69	324	897	
Total	129	129	7405	7405	167	167	4023	4023	153	153	4394	4394	

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.