

Fecha de Publicación: 18 de octubre de 2013

Fecha de Información: 16 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\$1521,1 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	405,9	242,5	188,0	210,0	9,5	150,9	45,0
15-35	428,3	267,4	133,7	196,0	68,7	167,3	65,0
36-60	55,1	123,9	0,0	0,0	83,9	15,1	40,0
61-90	1,0	32,3	0,0	0,0	32,3	1,0	0,0
91-180	35,1	58,0	0,4	0,0	57,6	35,1	0,0
>180	13,5	18,0	1,4	0,0	6,6	3,5	10,0
Total	938,9	742,2	323,5	406,0	258,6	372,9	160,0

* 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	2,9 %	2,5 %	2,9 %	2,8 %
15-35	3,1 %	3,3 %	2,8 %	3,0 %
36-60	2,1 %	3,5 %	2,8 %	3,0 %
61-90	-	3,5 %	2,6 %	3,5 %
91-180	-	3,5 %	3,1 %	3,4 %
>180	0,0 %	3,1 %	3,1 %	1,6 %
Total	2,6 %	3,1 %	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	14 al 18 de octubre				21 al 25 de octubre				28 de oct. al 1 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	48	118	3312	2469	71	99	3022	2883	14	97	2547	2636
Intragrupa y off-shore***	0	0	1235	960	0	0	1662	1110	0	0	1003	858
Otros	117	48	385	1502	99	71	356	1047	97	14	737	794
Total	165	165	4932	4932	170	170	5041	5041	111	111	4288	4288

* 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.