

Fecha de Publicación: 22 de octubre de 2013

Fecha de Información: 18 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\$1118,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.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	258,1	363,1	240,1	109,6	13,0	38,5	110,0
15-35	239,9	210,8	122,5	59,4	5,3	97,4	83,0
36-60	14,0	6,8	0,0	0,0	6,0	13,2	0,8
61-90	2,6	15,9	0,0	0,0	13,4	0,1	2,5
91-180	106,6	111,6	10,2	0,0	59,5	64,6	42,0
>180	0,5	27,3	0,0	0,0	27,3	0,5	0,0
Total	621,7	735,4	372,8	169,0	124,4	214,4	238,3

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

*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**	47	122	3365	2524	71	100	3394	3280	14	110	2618	2684
Intragrupa y off-shore***	0	0	1250	973	0	0	1942	1240	0	0	1036	864
Otros	122	47	385	1503	100	71	349	1165	110	14	742	849
Total	169	169	5001	5001	171	171	5684	5684	124	124	4396	4396

* 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.