

Fecha de Publicación: 30 de octubre de 2013

Fecha de Información: 28 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\$1533,2 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	664,5	284,1	123,0	165,0	51,1	389,5	110,0
15-35	249,0	248,7	149,0	53,0	8,7	105,0	91,0
36-60	41,5	84,4	0,0	37,0	84,4	4,5	0,0
61-90	7,0	7,8	0,0	0,0	7,8	7,0	0,0
91-180	100,4	12,3	0,0	0,0	12,3	100,4	0,0
>180	2,5	31,8	0,0	0,0	31,8	2,5	0,0
Total	1065,0	669,3	272,0	255,0	196,3	609,0	201,0

* 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	1,4 %	3,0 %	2,7 %	2,6 %
15-35	2,9 %	3,5 %	3,1 %	3,2 %
36-60	-	3,4 %	3,2 %	3,4 %
61-90	-	3,4 %	3,0 %	3,2 %
91-180	-	3,5 %	3,1 %	3,2 %
>180	-	3,4 %	3,1 %	3,3 %
Total	2,1 %	3,3 %	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	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**	14	115	4463	3613	5	67	2720	2962	9	116	1687	1754
Intragrupa y off-shore***	0	0	1521	1095	0	0	1428	832	0	0	872	600
Otros	115	14	760	2036	67	5	505	859	116	9	411	616
Total	129	129	6744	6744	72	72	4653	4653	126	126	2970	2970

* 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.