

Fecha de Publicación: 6 de noviembre de 2013

Fecha de Información: 01 de noviembre 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\$1362,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	503,6	242,7	98,0	59,0	19,7	319,6	125,0
15-35	244,9	542,9	381,5	48,0	7,2	42,7	154,3
36-60	6,0	6,5	0,0	0,0	6,5	6,0	0,0
61-90	31,5	2,7	0,0	0,0	2,7	31,5	0,0
91-180	24,1	4,4	0,1	0,0	4,3	24,1	0,0
>180	20,0	17,5	0,0	0,0	12,2	14,8	5,3
Total	830,2	816,7	479,7	107,0	52,6	438,7	284,5

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

*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

Sector	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**	25	104	5281	3933	9	71	3917	3346	10	116	2053	2038		
Intragrupa y off-shore***	0	0	1655	1331	0	1	1575	906	0	0	944	708		
Otros	104	25	681	2353	71	8	535	1775	116	10	453	704		
Total	129	129	7617	7617	80	80	6027	6027	126	126	3451	3451		

* 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.