

Fecha de Publicación: 17 de octubre de 2013

Fecha de Información: 15 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\$1284,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,1%.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	209,6	71,8	59,0	88,0	12,8	121,6	0,0
15-35	501,5	212,7	139,0	186,0	26,5	268,3	47,3
36-60	134,7	56,6	0,4	0,0	6,2	84,7	50,0
61-90	8,1	13,0	0,0	0,0	13,0	8,1	0,0
91-180	47,9	113,2	0,0	0,0	113,2	47,9	0,0
>180	3,6	9,2	0,0	0,0	9,2	3,6	0,0
Total	905,5	476,5	198,4	274,0	180,8	534,2	97,3

* 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	-	3,5 %	2,8 %	2,9 %
15-35	3,4 %	3,4 %	3,1 %	3,2 %
36-60	3,2 %	3,5 %	3,0 %	3,1 %
61-90	-	3,4 %	3,1 %	3,3 %
91-180	-	3,4 %	3,0 %	3,3 %
>180	-	3,2 %	2,7 %	3,1 %
Total	3,3 %	3,4 %	3,0 %	3,1 %

*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	116	3101	2374	69	95	2831	2755	16	95	2537	2604
Intragrupa y off-shore***	0	0	1156	840	0	0	1560	1020	0	0	977	853
Otros	116	47	389	1432	95	69	356	971	95	16	731	789
Total	163	163	4647	4647	164	164	4746	4746	111	111	4246	4246

* 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.